

Exhibit 27, Part 6 of 15



SYSTEMVEJLEDNING

- Ændringsmeddeelse - opgave tekst fra udsteder (TI20281v) KI
- Ændringsmeddeelse - beholdningsoplysninger - aktier (TI20282v) KI
- Ændringsmeddeelse - beholdningsoplysninger - obligationer (TI20283v) KI
- Ændringsmeddeelse - kapitaloplysninger (TI20284v) KI
- Ændringsmeddeelse - provenuoplysninger uden skat/afgift (TI20285v) KI
- Ændringsmeddeelse - provenuoplysninger med skat/afgift (TI20339v) KI
- Ændringsmeddeelse - betalingsoplysninger - udbytteaktier (TI20311v) KI
- Udbyttemeddeelse - adresseoplysninger (TI20310v) KI
- Udbyttemeddeelse - betalingsoplysninger (TI20312v) KI
- Advisering til kontofører - beholdningsoplysninger - aktier (TI20286v) KI
- Advisering til kontofører - beholdningsoplysninger - obligationer (TI20287v) KI
- Advisering til kontofører - provenu oplysninger uden tilbageholdt skat/afgift (TI20288v) KI
- Status på beholdning efter en afvikling af en corporate action (TI20289v) KI
- Papiroplysninger - udbytte ved beregning (TI20315v) KI
- Papiroplysninger - udbytteaktier ved beregning (TI20314v) KI
- Udbytteoversigt - betalingsformidling til KI (TI20316v) KI
- Udbytteoversigt - betalingsformidling til KI - udbytteaktier (TI20317v)
- Advisering til ejerbogsfører - beholdningsoplysninger ifm. afvikling af en corporate action (TI20292v) AB
- Advisering til ejerbogsfører - navne- og adresseoplysninger ifm. afvikling af en corporate action (TI20304v) AB
- Ejerbogsførers navn og adresse (TI20306v) AB
- Skift af ISIN på preadvice - tegning (TI20080v) FH, PK, KI, ST

- Slut på selskabshændelse kørsel (TI20303v) CD

Omregning af bruttoudbyttebeløb i valuta for provenutype = 3 (udbytte)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel – Omregning af provenu til basis valuta (TI20166v) Modtager (kommentar):
DC (behandling-af-provenu kode=4)
- Omregnede rente og bruttoudbytte til basisvaluta (TI20108v) KI og PK
- Afslutning på periodisk kørsel - Omregning af provenu til basis valuta (TI20167v) DC (behandling-af-provenu kode=4)

Dannelse af likviditetsoversigt for provenutype = 3 (udbytte)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel - Dannelse af likviditetsoversigt (TI20166v) Modtager (kommentar):
DC (behandling-af-provenu kode=2)
- Nettopåvirkning i likviditet pr. dispositionsdag (TI20182v) PK
- Afslutning på periodisk kørsel – Dannelse af likviditetsoversigt (TI20167v) DC (behandling-af-provenu kode=2)

Betalingsformidling for provenutype = 3 (udbytte)

Info-meddelelser:

Modtager (kommentar):



SYSTEMVEJLEDNING

- | | |
|---|--|
| <ul style="list-style-type: none"> • Start på periodisk kørsel - Dannelse af betalingsformidling (TI20166v) • Posteringsgrundlag pr. værdipapirkonto pr. pengekonto (TI20138v) • Posteringsgrundlag pr. debetkonto (TI20197v) * • Posteringsgrundlag pr. afkast/afregningskonto (TI20198v) • Afstemningsoplysninger, periodiske betalinger (TI20106v) * • Afslutning på periodisk kørsel – Dannelse af betalingsformidling (TI20167v) | DC (behandling-af-provenu
kode=3)
PK
PK
PK
UD
DC (behandling-af-provenu
kode=3) |
|---|--|

Dannelse af likviditetsoversigt for provenutype = 4 (ad hoc)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel - Dannelse af likviditetsoversigt (TI20166v)
- Nettopåvirkning i likviditet pr. dispositionsdag (TI20182v)
- Afslutning på periodisk kørsel – Dannelse af likviditetsoversigt (TI20167v)

Modtager (kommentar):
DC (behandling-af-provenu
kode=2)
PK
DC (behandling-af-provenu
kode=2)

Betalingsformidling for provenutype = 4 (ad hoc)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel - Dannelse af betalingsformidling (TI20166v)
- Posteringsgrundlag pr. værdipapirkonto pr. pengekonto (TI20138v)
- Posteringsgrundlag pr. debetkonto (TI20197v)
- Posteringsgrundlag pr. afkast/afregningskonto (TI20198v)
- Afstemningsoplysninger, periodiske betalinger (TI20106v)
- Afslutning på periodisk kørsel – Dannelse af betalingsformidling (TI20167v)

Modtager (kommentar):
DC (behandling-af-provenu
kode=3)
PK
PK
PK
UD
DC (behandling-af-provenu
kode=3)

Omregning af bruttoudbyttebeløb i valuta for provenutype = 5 (udbyttelignende udlodning)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel – Omregning af provenu til basis valuta (TI20166v)
- Omregnede rente og bruttoudbytte til basisvaluta (TI20108v)
- Afslutning på periodisk kørsel - Omregning af provenu til basis valuta (TI20167v)

Modtager (kommentar):
DC (behandling-af-provenu
kode=4)
KI og PK
DC (behandling-af-provenu
kode=4)

Dannelse af likviditetsoversigt for provenutype = 5 (udbyttelignende udlodning)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel - Dannelse af likviditetsoversigt (TI20166v)
- Nettopåvirkning i likviditet pr. dispositionsdag (TI20182v)
- Afslutning på periodisk kørsel – Dannelse af likviditetsoversigt (TI20167v)

Modtager (kommentar):
DC (behandling-af-provenu
kode=2)
PK
DC (behandling-af-provenu
kode=2)

Betalingsformidling for provenutype = 5 (udbyttelignende udlodning)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel - Dannelse af betalingsformidling (TI20166v)
- Posteringsgrundlag pr. værdipapirkonto pr. pengekonto (TI20138v)
- Posteringsgrundlag pr. debetkonto (TI20197v)
- Posteringsgrundlag pr. afkast/afregningskonto (TI20198v)
- Afstemningsoplysninger, periodiske betalinger (TI20106v)

Modtager (kommentar):
DC (behandling-af-provenu
kode=3)
PK
PK
PK
UD



SYSTEMVEJLEDNING

- Afslutning på periodisk kørsel – Dannelse af betalingsformidling (TI20167v) DC (behandling-af-provenu kode=3)

Omregning af bruttoudbyttebeløb i valuta for provenutype = 6 (teknisk udbytte)

Info-meddelelser:

- Start på periodisk kørsel – Omregning af provenu til basis valuta (TI20166v) Modtager (kommentar): DC (behandling-af-provenu kode=4)
- Omregnede rente og bruttoudbytte til basisvaluta (TI20108v) KI og PK
- Afslutning på periodisk kørsel - Omregning af provenu til basis valuta (TI20167v) DC (behandling-af-provenu kode=4)

U2 - skattekørsel

Info-meddelelser:

- Afstemning udbytte - total U2 - skattekørsel (TI20331v) Modtager (kommentar): UD
- Papiroplysninger udbytte ved U2 - skattekørsel (TI20332v) KI
- Oversigt over udbytteskat til KI (TI20321v) KI
- Afslutning på U2 - skattekørsel (TI20242v) DC (behandling-af-provenu kode=26)

*) I infoen vil aktieselskabs identen være angivet, som udstedende institut.

Udbytteforespørgsler

Forespørgsel på provenu

KI (TR20113v)

Info-meddelelser:

- Svar på forespørgsel, provenu (TI20155v) Modtager (kommentar): KI

Udbyttetransaktioner

Korrektion af omregnet rente- eller bruttoudbyttebeløb

PK/KI (TC20104v)

Info-meddelelser:

- Korrektion af rente og bruttoudbytte (TI20128v) Modtager (kommentar): KI og PK

Udbytteflytning

KI (TC20027v)

Info-meddelelser:

- Udbytteflytning til KI (TI20323v) Modtager (kommentar): KI
- Ændring af udbytteskat til udstederansvarlig (TI20328v) UD (Dannes kun hvis der sker ændring i udbytteskat overfor udsteder, og kun indtil U2 - skattekørsel har fundet sted.)

Ændring af anvendt udbytteerklæring

KI (TU20081v)

Info-meddelelser:

- Ændring af anvendt udbytteerklæring til KI (TI20322v) Modtager (kommentar): KI



SYSTEMVEJLEDNING

- Ændring af udbytteskat til udstederansvarlig (TI20328v)

UD (Dannes kun hvis der sker ændring i udbytteskat overfor udsteder, og kun indtil U2 - skattekørsel har fundet sted.)

Ændring af udbytteskat

KI (TU20029v)

Info-meddelelser:

- Ændring af udbytteskat til KI efter U2 - skattekørsel (TI20324v)

Modtager (kommentar):
KI

Fælles funktion for rente, udtrækning, udbytte og ad hoc

Pengekontrollen

Info-meddelelser:

- Start på en afviklingskørsel (TI20213v)
- Status på afviklingskørsel (TI20007v)
- Bogføringsposter fra en afviklingskørsel - kopi (TI20034v)
- Afslutning på en afviklingskørsel (TI20214v)

Modtager (kommentar):
DC
DC
BS
DC

Systemoverblik for automatisk pant

Panteret - transaktion, indsender, infoer og modtager

Annulering af panteretsønske

PK (TU20079v)

Info-meddelelser:

- Annuleret panteretsønske (TI20179v)

Modtager (kommentar):
PK, KI

Vis panteret pr. pantehaver

KI (TR20090v)

Info-meddelelser:

- Panteret pr. pantehaver (TI20193v)

Modtager (kommentar):
KI

Nedskrivning/ophævelse af panteret

PK (TU20080v)

Info-meddelelser:

- Nedskrevet/ophævet panteret (TI20180v)
- Etableret panteret fra en afviklingskørsel (TI20181v)

Modtager (kommentar):
PK's AH, KI

Sikkerhedsaftaler - positivlisten - transaktion, indsender, infoer og modtager

Tilføj handelsprodukt på positivliste

BS (TC20085v)

Info-meddelelser:

- Tilføjelse på positivliste (TI20187v)

Modtager (kommentar):
BS
Långivers AH,
Låntagers AH



SYSTEMVEJLEDNING

Ændring af værdikoefficient på handelsprodukt på positivliste BS (TU20085v)

Info-meddelelser:

- Ændret koefficient på positivliste (TI20196v)

Modtager (kommentar):
BS,
Långivers AH,
Låntagers AH

Sletning af handelsprodukt på positivliste BS (TU20085v)

Info-meddelelser:

- Fjernet fra positivliste (TI20195v)

Modtager (kommentar):
BS,
Långivers AH,
Låntagers AH

Vis positivliste Låntagers AH, KI, Långivers AH, BS (TR20089v)

Info-meddelelser:

- Handelsprodukt på positivliste (TI20192v) *

Modtager (kommentar):
Låntagers AH, KI,
Långivers AH, BS

Vis afviklingsdagens positivliste for sikkerhedsret Låntagers AH, KI, Långivers AH, BS (TR20225v)

Info-meddelelser:

- Handelsprodukt på afviklingsdagens positivliste (TI20204v)*

Modtager (kommentar):
Låntagers AH, KI,
Långivers AH, BS

Sikkerhedsaftaler - låntagersiden - transaktion, indsender, infoer og modtager

Tilknyt VP-konto til sikkerhedsretsaftale KI (TC20086v)

Info-meddelelser:

- Depot tilknyttet sikkerhedsretsaftale (TI20183v)³
- Ændret låntagersloft (TI20191v)²⁾
- Handelsprodukt på positivliste (TI20192v)³⁾
- Ændret sikkerhedsværdi (TI20219v)⁴⁾

Modtager (kommentar):
KI,
Låntagers AH
Långivers AH
KI,
Låntagers AH
Låntagers AH
Låntagers AH

Ændre låntagerloft

KI (TU20086v)

Info-meddelelser:

Modtager (kommentar):

* Info'en kommer kun, såfremt forespørgslen foretages via LU 6.2

³ Sendes kun til långivers AH ved tilknytning af første VP-konto til en sikkerhedsretsaftale, svarende til oprettelsen af selve sikkerhedsretsaftalen.

²⁾ Sendes ved oprettelse af selve sikkerhedsretsaftalen (dvs. tilknytning af første VP-konto) samt ved tilknytning af efterfølgende VP-konto til sikkerhedsretsaftalen, hvor loft-indikator og/eller loft ændres.

³⁾ Sendes ved oprettelse af sikkerhedsretsaftalen, dvs. tilknytning af første VP-konto.

⁴⁾ Sendes kun ved tilknytning/fjernelse af VP-konto til accepterede sikkerhedsretsaftaler, hvor sikkerhedsværdien ændres.



SYSTEMVEJLEDNING

- Ændret låntagerloft (TI20191v)

KI,
Låntagers AH

Fjern VP-konto fra sikkerhedsretsaftale
KI (TD20086v)

Info-meddelelser:

- Depot fjernet fra sikkerhedsretsaftale (TI20186v)⁵⁾
- Ændret sikkerhedsværdi (TI20219v)⁶⁾

Modtager (kommentar):
KI,
Långivers AH,
Låntagers AH
Låntagers AH

Vis sikkerhedsretsaftale

Låntagers AH, KI (TR20083v)

Info-meddelelser:

- Oplysning om en sikkerhedsretsaftale (TI20188v)

Modtager (kommentar):
Låntagers AH, KI

Vis sikkerhedsværdi af fremtidige handler

Låntagers AH, KI (TR20095v)

Info-meddelelser:

- Sikkerhedsværdien af fremtidige handler (TI20194v)

Modtager (kommentar):
Låntagers AH, KI

Vis sikkerhedsværdi af fremtidige handler uden penge

Låntagers AH, KI (TR20361v)

Info-meddelelser:

- Sikkerhedsværdien af fremtidige handler uden penge (TI20210v)

Modtager (kommentar):
Låntagers AH, KI

Sikkerhedsaftaler - långiversiden - transaktion, indsender, infoer og modtager

Accept af sikkerhedsretsaftale

BS (TC20087v)

Info-meddelelser:

- Ændret sikkerhedsretsaftale (långiveroplysninger) (TI20190v)
- Ændret sikkerhedsværdi (TI20219v)

Modtager (kommentar):
BS,
Låntagers AH
Långivers AH
Samtlige KI'ere på aftalen
Låntagers AH

Ændring af långiverloft

BS (TU20087v)

Info-meddelelser:

- Ændret långiverloft (TI20212v)

Modtager (kommentar):
BS,
Långivers AH,
Låntagers AH

Fjern accept fra (suspending) sikkerhedsretsaftale

BS (TD20087v)

Info-meddelelser:

Modtager (kommentar):

⁵⁾ Sendes kun til långivers AH ved fjernelse af sidste VP-konto til en sikkerhedsretsaftale, svarende til ophevelse af sikkerhedsretsaftalen.

⁶⁾ Sendes kun ved tilknytning/fjernelse af VP-konti til accepterede sikkerhedsretsaftaler, hvor sikkerhedsværdien ændres.



SYSTEMVEJLEDNING

- Ændret sikkerhedsretsaftale (längiveroplysninger) (TI20190v) BS,
Långivers AH,
Låntagers AH
Samtlige KI'ere på aftalen

Nedskriv sikkerhedstræk
BS (TU20084v)

Info-meddelelser:

- Nedskrevet sikkerhedstræk (TI20184v)

Modtager (kommentar):
BS,
Långivers AH,
Låntagers AH

Sikkerhedsaftaler - batch - transaktion, infoer og modtager

Info-meddelelser:

- Sikkerhedsværdi ved start af nyt afviklingsdøgn (TI20185v)
- Ændret sikkerhedsværdi i en afviklingskørsel (TI20216v)
- Sikkerhedstræk fra en afviklingskørsel – indirekte clearingdeltager (TI20189v)

Modtager (kommentar):
Låntagers AH
Låntagers AH
Långivers AH,
Låntagers AH

Fastholdelse af sikkerhedsret - transaktion, indsender, infoer og modtager

Etablering af fastholdelse af sikkerhedsret
BS (TC20320v)

VP

Info-meddelelser:

- Oplysninger om fastholdelse af sikkerhedsret til anmelder (TI20218v)
- Nedskrevet sikkerhedstræk (TI20184v) 1)
- Ændret sikkerhedsværdi (TI20219v) 2)
- Oplysning om rettighed (TI20220v) 2) 3)
- Status på beholdning (TI20047v) 2)

Modtager (kommentar):
Långivers BS

Långivers AH,
Låntagers AH
Låntagers AH
Långivers AH,
Modtagende KI
Långivers AH,
Låntagers AH
Berørte KI'ere
Långivers BS

Når fastholdelsen er gennemført fuldt ud

- Afviklet fastholdelse af sikkerhedsret til anmelder (TI20217v)

- 1) Hvis der på indrapporteringstidspunktet er en eller flere ISIN-udelukkelser, dannes infoen på indrapporteringstidspunktet, og ved hvert ophør af en ISIN-udelukkelse indtil sikkerhedstrækket er dækket.
- 2) Sendes kun til långivers AH ved tilknytning af første VP-konto til en sikkerhedsretsaftale, svarende til oprettelsen af selve sikkerhedsretsaftalen.
- 3) Infoen dannes kun, hvis der er anmeldt en rettighed på afgivende VP-konto.



SYSTEMVEJLEDNING

Systemoverblik for clearing og settlement

Sammenhænge mellem transaktioner og info-meddelelser

Denne sammenhæng er skitseret ved nogle tegninger i separat dokument kaldet Appendiks A

Ændringer afledt af euroens indførelse.

Handelsafvikling

Info-meddelelser:

- Specifikation af beløb, bogført i anden valuta end afviklingsvalutaen (TI20093v) a)

Modtager (kommentar):

BS

Tegningsblok 14

Info-meddelelser:

- Specifikation af beløb, bogført i anden valuta end afviklingsvalutaen (TI20093v) e)

Modtager (kommentar):

BS

PVP-afvikling

Info-meddelelser:

- Start på en PVP-afviklingskørsel (TI20098v)
- Manglende dækning i en PVP-afviklingskørsel (TI20097v) b)
- Manglende dækning i en PVP-afviklingskørsel (TI20094v) b)
- Status på en PVP-afviklingskørsel (TI20096v) b)
- Manglende dækning i en PVP-afviklingskørsel (TI20095v) c)
- Specifikation af beløb, der skal overføres til likviditetsstiller (TI20085v) c) d)
- Bogføringsposter fra en afviklingskørsel - kopi (TI20034v)
- Afslutning på en PVP-afviklingskørsel (TI20099v)

Modtager (kommentar):

DC

NB

BS

DC

GS

GS

BS

DC

Flyt PVP engagementer til likviditetsstiller

Info-meddelelser:

- Specifikation af beløb, overført til likviditetsstiller (TI20083v)
- Specifikation af beløb, overført til likviditetsstiller (TI20081v) d)

Modtager (kommentar):

BS

GS

Etablering af en PVP-afviklingskørsel

Info-meddelelser:

- Nyoprettet PVP-afviklingskørsel (TI20025v)

Modtager (kommentar):

DC

Ved sletning af en PVP-afviklingskørsel

Info-meddelelser:

- Slettet PVP-afviklingskørsel (TI20026v)

Modtager (kommentar):

DC

- a) Sendes, hvis handelen er i euro og handelen er medtaget i en af følgende handelsafviklinger: blok 10, blok 20 eller blok 30.
- b) Sendes når PVP-afviklingen er nødlidende (1., 2., 3. og ved 4. pengekontrol).
- c) Sendes når pengekontrollen er gentaget (2., 3. og ved 4. pengekontrol)



SYSTEMVEJLEDNING

- d) Infoen indeholder nettobeløbet pr. afvikling, pr. deltager, der er nødlidende.
- e) Sendes hvis provenuet er i euro.

Systemoverblik for papirfilter for udenlandske værdipapirer

Papirfilter for udenlandske værdipapirer - transaktion, indsender, infoer og modtager

VP

Info-meddelelser:

- Oprettelse af ny ISIN i deltagerens papirfilter (TI20176v)

Modtager (kommentar):

AH

Forespørgsel på VP's basisregister over udenlandske værdipapirer

AH, KI, FH, PK, ST (TR20368v)

Info-meddelelser:

- Udenlandske værdipapirer i VP's basisregister (TI20174v)

Modtager (kommentar):

Anmelder

Forespørgsel på deltagerens papirfilter AH, KI, FH, PK (TR20369v)

Info-meddelelser:

- Udenlandske værdipapirer i deltagerens papirfilter (TI20175v)

Modtager (kommentar):

Anmelder

Sletning af udenlandske værdipapirer i eget papirfilter AH (TD20369v)

Info-meddelelser:

- Sletning af udenlandske værdipapirer i deltagerens papirfilter (TI20226v)

Modtager (kommentar):

AH

Etablering af udenlandske værdipapirer i eget papirfilter AH (TC20380v)

Info-meddelelser:

Modtager (kommentar):

Modtager (kommentar):

Systemoverblik for investeringsforeningsklassifikationer

Investeringsklassifikation - transaktion, indsender, infoer og modtager

VP

Info-meddelelser:

- Ekstrakt af investeringsforeningsklassifikation (TI20230v)

Modtager (kommentar):

DC

Etablering af investeringsforeningsklassifikation UD (TC20381v)

Info-meddelelser:

- Etablering af investeringsforeningsklassifikation (TI20227v)

Modtager (kommentar):

DC

Ændring af investeringsforeningsklassifikation UD (TU20381v)

Info-meddelelser:

- Ændring af investeringsforeningsklassifikation (TI20228v)

Modtager (kommentar):

DC

Sletning af investeringsforeningsklassifikation UD (TD20381v)

Info-meddelelser:

- Sletning af investeringsforeningsklassifikation (TI20229v)

Modtager (kommentar):

DC



SYSTEMVEJLEDNING

03 Funktionsbeskrivelser

Alle refererede infonumre og transaktionsnumre er beskrevet med versionsnummer=v. (f.eks. TC20182v)

Clearing og Settlement

Gennemførelse af en afviklingskørsel

Formål:

At kontrollere, om handler kan gennemføres, og afvikle og betalingsformidle de godkendte handler.

Behandling i VP:

Som start og afslutning på en afviklingskørsel dannes meddelelse til datacentrene om, at afviklingskørselen er påbegyndt/afsluttet.

Værdi af sikkerhedsretsaftaler:

Ved starten af dagens første afviklingskørsel (inden gennemførelse af afviklingen) beregnes værdien af sikkerhedsretsaftaler. Den beregnede værdi af aftalerne dokumenteres i en særskilt info-meddelelse.

Se i øvrigt Sikkerhedsretten om sikkerhedsretsaftalers anvendelse i handelsafviklingen.

Handler, der kan afvikles:

Den enkelte værdipapirkonto opdateres med den for afviklingskørselen totale til-og/eller fragang i:

- mængde
- navnenoteret mængde
- udtrukket mængde

For hver primære betalingsstiller (clearingdeltagere, der fører pengekonti i Danmarks Nationalbank) optælles pr. valuta den totale til- og/eller fragang i handelsbeløb, der skal bogføres i Danmarks Nationalbank eller Den Europæiske Centralbank. Beløbene er summen af henholdsvis til- og/eller fragang i den aktuelle afviklingskørsel af:

- egne handler
- handler foretaget af deltagere, som den primære betalingsstiller har tildelt et trækningsmaksimum
- ikke-deltageres handler, som den primære betalingsstiller har inrapporteret på ikke-deltageres vegne

De gennemførte handler markeres, så det fremgår, at afvikling er foretaget.

Handler, der ikke kan afvikles:

Handler afvises, hvis den ønskede afviklingsdag er overskredet med 20 dage, og den aktuelle afviklingskørsel er afviklingsdagens sidste eller den sidste, hvori den angivne valuta indgår.

De afviste handler markeres, så det fremgår, at afvikling ikke kan foretages.

Handler, der udskydes til senere afvikling:

Handler, der har fundet makker, men som ikke er klar til afvikling, udskydes til førstkommande afviklingskørsel af samme type, hvor de igen vil blive forsøgt gennemført.

Der kan være følgende årsager til, at en handel udskydes:

- den angivne ISIN er udelukket fra afvikling
- preadvice mangler instruct
- modpart har ikke indsendt instruct



SYSTEMVEJLEDNING

- manglende dækning i beholdning
- manglende dækning i penge (i forhold til sikkerhedsværdi og/eller trækningsmaksimum)

Annulling af udløbne instruktioner:

Ikke gennemførte handler i den aktuelle afviklingskørsel kontrolleres for, om instruktionen stadig er gældende. Hvis det ikke er tilfældet, annulleres instruktionen.

De pågældende preadvices markeres med, at instruktion er udløbet.

Tilladt trækningsmaksimum:

For clearingdeltagere med afviklingskonto i Danmarks Nationalbank (primære betalingsstiller) modtages der et nyt tilladt trækningsmaksimum fra Danmarks Nationalbank eller fra Den Europæiske Centralbank før hver afviklingskørsel. For øvrige clearingdeltagere føres nettovirkningen af det gældende trækningsmaksimum videre fra den ene afviklingskørsel til den næste. Det forbrugte træk vil dog blive nulstillet ved afslutningen af hver afviklingsdag. Det samme vil ske, hvis et nyt tilladt trækningsmaksimum indsendes.

Er der angivet en udløbsdato (afviklingsdato) i det tilladte trækningsmaksimum, nulstilles og lukkes dette automatisk efter den pågældende afviklingsdags sidste afviklingskørsel.

Behandling hos centraldeltager:

Hvis et preadvice er blevet udskudt fra en afviklingskørsel, skal det undersøges, om årsagen til udskydelsen kan afhjælpes.

Hvis et preadvice har fået annulleret sin instruktion, skal det afgøres, om en ny skal indsendes.

Ved afvisning af et preadvice skal et nyt preadvice med tilhørende instruktion indsendes, hvis handlen ønskes gennemført.

Uddata:

Der dannes bogføringsposter til Danmarks Nationalbank eller Den Europæiske Centralbank og info-meddelelser fra afviklingskørselen.

Udelukkelse af ISIN's fra afvikling

Formål:

At sikre, at der ikke kan flyttes beholdninger i en eller flere ISIN's i forbindelse med gennemførelse af den type periodiske kørseler, der påvirker beholdningens størrelse.

Behandling i VP:

Når en periodisk kørsel, der påvirker beholdningens størrelse, fx udtrækning, bliver registreret i fondsregistret, gives der samtidig information til datacentrene om, hvilke ISIN's der vil blive udelukket og fra hvilket tidspunkt udelukkelsen er gældende.

For anmeldelser i de udelukkede ISIN's er der følgende konsekvenser:

- handler udskydes til den førstkommande afviklings kørsel af samme type
- overførsler og hovedbogsbevægelser lægges i venteposition ("postkasse") indtil udelukkelsen ikke længere er gældende
- strakspreadvices og multioverførsler afvises, så længe udelukkelsen er gældende

Ved afslutning af hver periodisk kørsel, ophæves udelukkelsen af de involverede ISIN's, hvorefter handler i disse igen medtages i afviklingskørseler og overførsler, hovedbogsbevægelser og strakspreadvices kan afvikles.



SYSTEMVEJLEDNING

Der gives information om ophævelsen til datacentrene.

Behandling hos centraldeltager:

Ud fra de adviserede udelukkelser skal deltagerne være opmærksomme på, i hvilke tidsrum afviklingen kan blive påvirket af udelukkede ISIN's.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser om henholdsvis udelukkelse og ophævelse af ISIN's til de involverede parter.

Foruddefinerede afviklingskørsler

Formål:

At give deltagerne information om, hvilke fremtidige afviklingsdage/-kørsler det er muligt, at foretage anmeldelser til.

Behandling i VP:

Der vil som minimum være afviklingsdage/-kørsler for en periode af 12 måneder tilgængeligt. Som standard er der oprettet 6 handelsafviklingskørsler pr. dag. Tidspunktet for de enkelte kørsler fremgår af de udsendte info-meddelelser.

Behandling hos centraldeltager:

Der kan anmeldes handler til følgende handelsafviklingsblokke:

10	DKK, EUR
20	DKK, EUR
30	DKK, EUR
40	DKK
60	DKK
50	EUR

Derudover bliver følgende blokke anvendt i forbindelse med betalingsformidling:

Blok nr. Valuta

05	Udtrukne beløb fra statspapirer i DKK
14	Tegning og konvertering af konvertible obligationer i DKK og EUR
33	PVP - Levering af EUR mod DKK i forbindelse med EUR-handler afviklet i blok 10, 20 og 30.
35	Øvrige periodiske betalinger i DKK
45	Periodiske betalinger i EUR
65	Periodiske betalinger i ISK
55	Periodiske betalinger i SEK

Uddata:

Der dannes info-meddelelser om oprettede/slettede afviklingskørsler.

Forcering af transaktioner

Nyanmeldt rettighedshaver:

Der kræves forcering (forceringsmarkeringskode = 3), når der på værdipapirkontoen er anmeldt en rettighedshaver samme dag. Forceringskravet gælder fra rettigheden er registreret i "daglig journal" og resten af det pågældende afviklingsdøgn samt den efterfølgende aften/nat i nyt afviklingsdøgn til og med nattens sidste afviklingskørsel, p.t. blok 30 med retsvirkningstidspunkt kl. 06.00.



SYSTEMVEJLEDNING

Kontostatus:

Der kræves forcering (forceringsmarkeringsskode = 2), når værdipapirkontoen er forsynet med kontostatus. Der skal forceres fra det tidspunkt kontostatus er registreret i VP og indtil kontostatus slettes (on-line registrering).

Meddeelse om manglende dækning på grund af udtrækning
Formål:

At informere om handler til førstkommande blok 10, som ikke vil kunne gennemføres på grund af manglende dækning i beholdning, forårsaget af en udtrækningskørsel (udtræk-1).

Behandling i VP:

Umiddelbart efter at udtrækningskørslen er afviklet, gennemfører VP en foreløbig beholdningskontrol, der kontrollerer alle fragange i de beholdninger, som har deltaget i udtrækningen.

På VP-konti, hvor der konstateres overtræk, udsendes altid en meddeelse om den manglende mængde til det kontoførende institut.

I de tilfælde, hvor en afviklingsansvarlig (FH/ST) er modpart i en privat handel i overtræk, får den afviklingsansvarlige også en meddeelse.

I de tilfælde, hvor et fjernmedlem (ST) er modpart i en privat handel i overtræk, får fjernmedlemmet også en meddeelse.

Hvis anmelderen er forskellig fra "handlet-for", vil anmelderen også modtage en meddeelse.

Behandling hos centraldeltager:

De handler, hvorpå der er givet meddeelse om overtræk, vil kun kunne gennemføres, hvis handlerne korrigeres, inden blok 10 påbegyndes. Det kan gøres på to måder. Enten ved at nedskrive handlen med den udtrukne mængde eller ved at tilføre VP-kontoen en mængde svarende til den udtrukne.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20222v	Manglende dækning i foreløbig beholdningskontrol efter udtrækning
TI20223v	Manglende dækning hos modpart i foreløbig beholdningskontrol efter udtrækning

Annulering af handelsafvikling i en afviklingskørsel

Annulering af handelsafvikling i en afviklingskørsel kan forekomme i de situationer, hvor VP på grund af problemer er kommet bagud med afvikling.

I forbindelse med annulering af en afviklingskørsel udsendes information via AbonnementService, 'status på VP-systemet', med beskrivelse af, hvorledes situationen skal håndteres. Vær specielt opmærksom på følgende forhold:

Instructs

Uanset at der ikke finder handelsafvikling sted, vil gennemførelsen af afviklingskørslen uden handelsafvikling tælle med i det antal gange, instructen har været brugt. Det betyder, at handler, der er instruet med en gyldighed på en kørsel, skal reinstructes for at være med i den efterfølgende ordinære kørsel.



SYSTEMVEJLEDNING

Preadvice

Et preadvice's levetid - afviklingsdagen plus de 20 efterfølgende afviklingsdage - påvirkes ikke af, at en eller flere afviklingskørsler i perioden har været uden handelsafvikling.

Etablering af overførsel (TC20001v)

Formål:

At overføre en specifik beholdning fra en værdipapirkonto til en anden.

Behandling hos centraldeltager:

Transaktionen indrapporteres af det afgivende kontoførende institut (KI) eller af et opdateringsrelateret afgivende KI.

Bemærk

Såfremt overførslen bliver gennemført vil den få retsvirkning fra det tidspunkt (accepttidspunkt), der er angivet i OK-svaret på transaktionen.

Eventuel indberetning til Danmarks Nationalbank af en overførsel mellem en valutaindlændning og en valutaudlændning skal foretages af det kontoførende institut, der fører værdipapirkontoen for valutaindlændningen.

Udtrukne obligationsbeholdninger indrapporteres separat med angivelse af, at den angivne mængde er udtrukket.

Transaktionen afvises ligeledes hvis det er en overførsel til en Link Up CSD, se Forretningsmæssigvejledning, Clearingvejledning Link Up-Markets.

Forcering:

Se beskrivelse i afsnit Forcering af transaktioner

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendte transaktioner opdateres på de involverede værdipapirkonti umiddelbart efter indrapporteringen.

Transaktionen afvises, hvis ISIN er udelukket på indrapporteringstidspunktet og følgende betingelser er opfyldt:

- "fra" værdipapirkontoen indgår i en sikkerhedsrettsaftale og
- ISIN indgår på positivlisten og
- der er et gældende sikkerhedstræk

Uddata:

Som udgangspunkt sendes der altid info-meddelelser til de involverede parter som vist i afsnit 3. Ved sammenfald imellem parterne udsendes ud fra følgende princip:

TI20011v	Overførselsoplysninger sendes til anmelder
TI20050v	Afviklet overførsel sendes til anmelder
TI20016v	Afviklet overførsel sendes kun til KI, når KI er forskellig fra anmelder
TI20047v	Status på beholdning sendes altid til KI
TI20219v	Ændret sikkerhedsværdi

Ved afvisning af en overførsel sendes info:

TI20053v	Afvisning af overførsel til anmelder
----------	--------------------------------------



SYSTEMVEJLEDNING

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 AFGIVER-KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 AFGIVER-KONTO. (VAERDIPAPIRKONTO)	
03 NUMMER	O
02 MODTAGER-KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 MODTAGER-KONTO. (VAERDIPAPIRKONTO)	
03 NUMMER	O
02 HANDELSPRODUKT.	
03 ISIN	O
02 OVERFOERSEL	
03 MAENGDE	O
03 AFGIVER-SUB-IDENT-NUMMER	F
03 MODTAGER-SUB-IDENT-NUMMER	F *
03 INTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 EKSTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 NAVNENOTERINGSKODE	F
03 UDTRUKKET-KODE	F
03 REFERENCENUMMERSKIFT-KODE	F
03 FORCERMARKEKODE	F

O = obligatorisk, F = frivillig, *) = skal udfyldes ved overførsel til en CSD.

OBS: Det er ikke muligt at etablere overførsler til Link Up CSD'er.

NB. Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Etablering af preadvice (TC20002v)

Formål:

At indrapportere en handel af en specifik værdipapirbeholdning til senere afvikling.

Behandling hos centraldeltager:

Der er mulighed for at indrapportere 4 typer af preadvices:

part:		modpart:
1. afviklingsansvarlig	-	Afviklingsansvarlig
2. afviklingsansvarlig	-	ikke afviklingsansvarlig
3. ikke afviklingsansvarlig	-	Afviklingsansvarlig
4. ikke afviklingsansvarlig	-	ikke afviklingsansvarlig

Hvis handlet-for deltager-ID eller BIC er udfyldt, skal part være en afviklingsansvarlig (FH, ST), og værdipapirkontoen for part skal have afviklingsgruppe "FH" eller "ST". Ellers skal værdipapirkontoen have afviklingsgruppe "AI", "UI" eller "PR"(ikke afviklingsansvarlig).

Hvis handlet-med deltager-ID eller BIC er udfyldt, skal modpart være en afviklingsansvarlig (FH, ST). Ellers skal den angivne værdipapirkonto for modpart have afviklingsgruppe "AI", "UI" eller PR"(ikke afviklingsansvarlig).



SYSTEMVEJLEDNING

Anmelder af preadvices af typerne 1 + 2 kan være en af følgende:

- en afviklingsansvarlig, som har adgang til værdipapir kontoen enten som kontoførende institut (KI) eller som opdateringsrelateret kontoførende institut
- en afviklingsansvarlig med handelsfuldmagt.

Anmelder af preadvices af typerne 3 + 4 kan være en af følgende:

Ved salg:

- kontoførende institut for værdipapirkontoen
- et opdateringsrelateret kontoførende institut
- en afviklingsansvarlig med handelsfuldmagt.

Ved køb, og hvor handelsbeløb er større end 0:+

- pengekontoførende institut (PK)
- et opdateringsrelateret pengekontoførende institut

Udtrukne obligationsbeholdninger indrapporteres separat med angivelse af, at den angivne mængde er udtrukket.

For O = obligatorisk henholdsvis F = frivillig udfyldelse af transaktionens felter, se datafelter.

Dan modpart

Når modpartens preadvice skal dannes automatisk (DAN-MODPART-KODE = 1), gælder følgende:

Handler med beløb:

Når der ses bort fra køb fra en ikke afviklingsansvarlig, hvor afviklingsansvarlig har handelsfuldmagt til værdipapirkontoen, kan koden kun anvendes inden for samme aftalehaver og kun for preadvices af typen 2 og 4.

Ved salg til en ikke afviklingsansvarlig skal fragangs-pengekontoen ligeledes føres under den samme aftalehaver.

Handler uden beløb:

Koden kan anvendes på tværs af aftalehavere, for preadvices af typen 2 og 4, i følgende situationer:

- salg til en ikke afviklingsansvarlig
- en afviklingsansvarligs køb fra en ikke afviklingsansvarlig, hvis afviklingsansvarlig har en handelsfuldmagt til værdipapirkontoen.

Forcering:

Hvis preadvice er med instruct, se beskrivelse i afsnit 3.1 Forcering

Behandling i VP:

Ved modtagelsen i VP forsøges et preadvice altid makkersøgt med et preadvice indrapporteret af den anden part i handlen.

Makkersøgning:

Alle typer preadvices makkersøges efter følgende kriterier:

- afviklingsdag skal være ens
- handelsdag skal være ens
- ønsket afviklingskørsel:



SYSTEMVEJLEDNING

- 1) hvis ingen af parterne har udfyldt feltet, knyttes handlen til den første mulige afviklingskørsel på afviklingsdagen
- 2) hvis begge parter har udfyldt feltet, skal ønsket afviklingskørsel være ens. Handlen knyttes til den angivne afviklingskørsel.
- ISIN skal være ens
- mængde-tilgang-fragang-kode skal være " modsat "
- mængde skal være ens
- udtrukket-kode skal være ens:
 - en evt. difference i handelsbeløb skal ligge inden for den tilladte tolerance på DKK 100,00 eller modværdien heraf i en anden valuta (NB. ved afvikling af handlen er det altid sælgers beløb, der anvendes som afregningsbeløb)
- valuta skal være ens

Hvis part-sub-ident-nummer er udfyldt, skal det være lig med modpartens modpart-sub-ident-nummer og omvendt.

Hvis handlet-for/handlet med deltager-ID BIC er udfyldt, fremfindes CD-identen og det er denne der matches på.

Hvis part KI BIC er udfyldt, fremfindes KI-identen og det er denne der matches på.

Derudover gælder følgende specifikke kriterier:

1.	afviklingsansvarlig - afviklingsansvarlig:
	- handlet-for skal være lig med modpartens handlet-med
2.	afviklingsansvarlig - ikke afviklingsansvarlig
	- handlet-for skal være lig med modpartens handlet-med
	- modpart-ki skal være lig med modpartens part-ki
	- modpart-konto skal være lig med modpartens part-konto eller BIC-modpart-vp-konto skal være lig med modpartens BIC-part-vp-konto
	Hvis følgende er udfyldt, og afviklingsansvarlig køber (dvs. det er en tilgang i mængde), skal: <ul style="list-style-type: none"> - modpart-ikke-deltager (betalingssted) være lig med modpartens part-ikke-deltager (betalingssted) og modpart-ikke-deltagers-penge-kto være lig med modpartens part-ikke-deltagers-penge-kto.
	NB. Hvis afviklingsansvarlig sælger (dvs. det er en fragang i mængde), bliver der ikke makkersøgt på felterne. Det vil i så fald være modpartens pengekonto, der er gældende, dvs. den konto, hvorfra pengene skal debiteres.
3.	ikke afviklingsansvarlig - afviklingsansvarlig:
	- handlet-med skal være lig med modpartens handlet-for
	- part-ki skal være lig med modpartens modpart-ki
	- part-konto skal være lig med modpartens modpart-konto
	Hvis følgende er udfyldt, og ikke afviklingsansvarlig sælger (dvs. det er en tilgang i mængde), skal: <ul style="list-style-type: none"> - part-ikke-deltager (betalingssted) skal være lig med modpartens modpart-ikke-deltager (betalingssted-), hvis modpartens modpart-ikke-deltager er udfyldt - part-ikke-deltagers-penge-kto skal være lig med modpartens modpart-ikke-deltagers-penge-kto, hvis modpartens modpart-ikke-deltagers-penge-kto er udfyldt
4.	ikke afviklingsansvarlig - ikke afviklingsansvarlig:
	- part-ki skal være lig med modpartens modpart-ki
	- part-konto skal være lig med modpartens modpart-konto eller BIC-part-vp-konto skal være lige



SYSTEMVEJLEDNING

	med modpartens BIC-modpart-vp-konto
	Hvis følgende er udfyldt, og det er en tilgang i mængde, skal:
-	modpart-ikke-deltager (betalingssted) være lig med modpartens part-ikke-deltager (betalingssted) og modpart-ikke-deltagers-penge-kto være lig med modpartens part-ikke-deltagers-penge-kto.
	NB. Hvis det er en fragang i mængde, bliver der ikke makkersøgt på felterne. Det vil i så fald være modpartens pengekonto, der er gældende, dvs. den konto, hvorfra pengene skal debiteres.
	Godkendte transaktioner afvikles i den førstkommande henholdsvis den angivne afviklingskørsel.

Uddata:

Som udgangspunkt sendes der altid info-meddelelser til de involverede parter. Ved sammenfald mellem disse udsendes ud fra følgende principper:

Beholdningssiden

Ved modtagelse:

Der sendes altid en info til anmelder (TI20022v) og der sendes info til handlet-med (TI20010v), hvis handlet-med er udfyldt, ellers sendes der til modpart-KI (TI20009v).

Når part er en afviklingsansvarlig, sendes info til handlet-for (TI20021v), hvis handlet-for er forskellig fra anmelder.

Når part er en ikke afviklingsansvarlig, sendes info til part-KI (TI20009v), hvis part-KI er forskellig fra anmelder.

Ved makkersøgning:

Der sendes info (TI20031v) til de samme parter som beskrevet ved modtagelse af preadvice.

Pengesiden

Ved modtagelse:

Hvis det er et salg til en ikke afviklingsansvarlig, og sælger samtidig angiver købers pengekonto, så sendes info (TI20027v) til købers pengekontofører, som er den, der skal godkende betalingen.

Ved makkersøgning:

Ved handel for en ikke afviklingsansvarlig sendes info (TI20060v) til pengekontoførende institut samt, hvis pengekontoføreren ikke er primær betalingsstiller(BS), info (TI20058v) til primær betalingsstiller(BS).

Ved handel for afviklingsansvarlig, som ikke er tilsluttet Nationalbankens betalingssystem i BEC som primær betalingsstiller, sendes info (TI20058v) til afviklingsansvarligs primære betalingsstiller(BS).

De samme infoer som nævnt ved makkersøgning sendes ved:

- annullering af preadvice
- udskydelse af handel
- når handlen er klar til afvikling (begge sider er instrueret)
- udløb af et instruct

DATAFELTER

	Type 1	Type 2	Type 3	Type 4
02 ANMELDELSE.				
03 AFSENDER-REFERENCE	O	O	O	O
02 HANDLET-FOR. (DELTAGER)				
03 IDENTIFIKATION	O 12)	O 12)	/	/



SYSTEMVEJLEDNING

02 PART-KI. (DELTAGER)				
03 IDENTIFIKATION	O 14)	O 14)	O 14)	O 14)
02 PART-KONTO. (VAERDIPAPIRKONTO)				
03 NUMMER	O	O	O	O
02 HANDLET-MED. (DELTAGER)				
03 IDENTIFIKATION	O 13)	/	O 13)	/
02 MODPART-KI. (DELTAGER)				
03 IDENTIFIKATION	/	O 15)	/	O 15)
02 MODPART-KONTO. (VAERDIPAPIRKONTO)				
03 NUMMER.	/	F 11)	/	F 11)
02 AFVIKLINGS DAG.				
03 AFVIKLINGS-DATO	O	O	O	O
02 OENSKET-AFVIKLINGSKOERSEL.				
03 KOERSELSBLOK	F	F	F	F
02 HANDELSPRODUKT.				
03 ISIN	O	O	O	O
02 PART-IKKE-DELTAGER. (BETALINGSSTED)				
03 REGISTRERINGSNUMMER	/	/	O 1)	O 1)
02 MODPART-IKKE-DELTAGER. (BETAL-STED)				
03 REGISTRERINGSNUMMER	/	F 3)	/	F 3)
02 MODPART-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)				
03 AFSENDER-REFERENCE	/	F 6)	/	F 6)



SYSTEMVEJLEDNING

02 PREADVICE				
03 MAENGDE-TILGANG-FRAGANG-KODE	O	O	O	O
03 MAENGDE	O	O	O	O
03 BELOEB	F	F	F	F
03 PART-SUB-IDENT-NUMMER	F	F	F	F
03 MODPART-SUB-IDENT-NUMMER	F 2)	F	F 2)	F
03 PART-IKKE-DELTAGERS-PENGE-KTO	/	/	O 1)	O 1)
03 MODPART-IKKE-DELTAGERS-PENGE-KTO	/	F 3)	/	F 3)
03 INTERN-POSTERINGSTEKST	F	F	F	F
03 EKSTERN-POSTERINGSTEKST	F	F	F	F
03 NAVNENOTERINGSKODE	F	F 8)	F	F 8)
03 UDTRUKKET-KODE	F	F	F	F
03 KONTANTFORBEHOLDSKODE	/	F 4)	/	/
03 INSTRUCT-KODE	F	F	F	F
03 GYLDIGHEDSPERIODEKODE	F 5)	F 5)	F 5)	F 5)
03 DAN-MODPART-KODE	/	F 7)	/	F 7)
03 FORCERMINGSMARKERINGSKODE	F	F	F	F
03 PANTERET-OENSKE-KODE	/	F 10)	F 9)	F 9)
03 BIC-PART-VP-KONTO	/	/	F	F
03 BIC-MODPART-VP-KONTO	/	F	/	F
03 HANDELSDATO	O	O	O	O
03 BIC-HANDLET-FOR	O 12)	O 12)	/	/
03 BIC-PART-KI	O 14)	O 14)	O 14)	O 14)
03 BIC-HANDLET-MED	O 13)	/	O 13)	/
03 BIC-MODPART-KI	/	O 15)	/	O 15)
02 VALUTA				
03 ISO-KODE	F	F	F	F
02 PART-DELTAGER. (BETALINGSSTED)				
03 REGISTRERINGSNUMMER	F	F	/	/
02 PART-DELTAGER-PENGEKONTO (KONTO-REFERENCE)				
03 NUMMER	F	F	/	/

O = obligatorisk, F = frivillig, / = må ikke udfyldes

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

1)	=	må kun udfyldes når beløb > 0
2)	=	skal udfyldes ved handel med en CSD
3)	=	skal udfyldes ved dan-modpart-kode = 1 og beløb > 0
4)	=	må kun anvendes af afviklingsansvarlig af typen (FH) og kun når preadvicet er en fragang uden beløb
5)	=	må kun udfyldes ved instruct-kode = 1
6)	=	skal udfyldes ved dan-modpart-kode = 1
7)	=	hvis instruct-kode ikke udfyldes med kode = 1 (instruct skal genereres), bliver modparten heller ikke instructed. Dvs. begge sider skal efterfølgende instructes af anmelder, for at handlen kan gennemføres
8)	=	hvis det er en fragang og dan-modpart-kode = 1 og navnenoteringskode = 1, så vil tilgangen blive navnenoteret.
9)	=	må kun anvendes når preadvicet er en tilgang til en VP-konto af typen ikke-afviklingsansvarlig (AI, UI, PR) og handelsbeløb > 0 (handlen er med pengeclearing).



SYSTEMVEJLEDNING

		Kan desuden i en fragang angives med 1 hvis handelsbeløb > 0
10)	=	kan kun anvendes i forbindelse med dan modpart, hvor modparten er en ikke-afviklingsansvarlig. Modparten skal opfylde samme regel som for type 3
11)	=	hvis modpart-VP-konto ikke udfyldes, SKAL BIC-modpart-vp-konto være udfyldt.
12)	=	Enten HANDLET-FOR (Deltager-ID) eller BIC-HANDLET-FOR skal være udfyldt
13)	=	Enten HANDLET-MED (Deltager-ID) eller BIC-HANDLET-MED skal være udfyldt
14)	=	Enten PART-KI eller BIC-PART-KI skal være udfyldt
15)	=	Enten MODPART-KI eller BIC-MODPART-KI skal være udfyldt

Etablering af hovedbogsbevægelse (TC20003v)

Formål:

At opskrive eller nedskrive den cirkulerende mængde af et handelsprodukt.

Behandling hos centraldeltager:

Transaktionen indrapporteres af det udstedende institut (UD) eller et opdateringsrelateret udstedende institut.

Ved indfrielse kræves yderligere, at indsenderen også er kontoførende institut / opdateringsrelateret kontoførende institut for værdipapirkontoen.

Det angives i anmeldelsestype, om transaktionen er en emission eller en indfrielse.

Bemærk

- for handelsprodukter med matematisk udtrækning kan hovedbogsbevægelse indrapporteres indtil kl. 10.30 på trækningsdagen.
- hvis en hovedbogsbevægelse bliver gennemført, vil den få retsvirkning fra det tidspunkt (accepttidspunkt), der er angivet i OK-svaret på transaktionen.

Forcering:

Se Forcering af transaktioner

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendte transaktioner opdateres på handelsproduktets hovedbog og den angivne værdipapirkonto umiddelbart efter indrapporteringen.

Transaktionen afvises, hvis ISIN er udelukket på indrapporteringstidspunktet og følgende betingelser er opfyldt:

- det er en indfrielse og
- "fra" værdipapirkontoen indgår i en sikkerhedsretsaftale og
- ISIN indgår på positivlisten og
- der er et gældende sikkerhedstræk

Uddata:

Som udgangspunkt sendes der altid info-meddelelser til de involverede parter. Ved sammenfald imellem disse udsendes ud fra følgende princip:

- | | |
|----------|--|
| TI20023v | Hovedbogsbevægelsesoplysninger sendes til anmelder |
| TI20049v | Afviklet hovedbogsbevægelse sendes til anmelder |
| TI20017v | Afviklet hovedbogsbevægelse sendes kun til UD, når UD er forskellig fra anmelder |
| TI20004v | Status på hovedbog sendes altid til UD |



SYSTEMVEJLEDNING

- TI20012v Afviklet hovedbogsbevægelse sendes kun til KI, når KI er forskellig fra anmelder eller KI er forskellig fra UD
 TI20047v Status på beholdning sendes altid til KI
 TI20219v Ændret sikkerhedsværdi

Ved afvisning af en hovedbogsbevægelse sendes info:

- TI20055v Afvisning af hovedbogsbevægelse til anmelder

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VAERDIPAPIRKONTO.	
03 NUMMER	O
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	O
02 ANMELDELSESTYPE	
03 KODE	O
02 HOVEDBOGSBEVAEGELSE	
03 MAENGDE	O
03 INTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 EKSTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 NAVNENOTERINGSKODE	F
03 FORCERMARKEKODE	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Etablering af straksSpreadvice (TC20004v)

Formål:

At gennemføre en strakshandel af en specifik værdipapirbeholdning.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være fondshandler (FH) eller storkunde (ST), der fører pengekonto til brug for afvikling af handler i Danmarks Nationalbank. For betaling i EUR skal anmelder føre en RTGS konto i Den Europæiske Centralbank. For betalingsfri handler er der ingen krav til pengekonto. Endvidere skal værdipapirkontoen have afviklingsgruppe "FH" eller "ST". Der skal altid inddrapptes af både den afgivende og den modtagende part i handlen.

Handlen kan være mod betaling eller betalingsfri.

Forcering:

Se beskrivelse i afsnit "Forcering af transaktioner"

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.



SYSTEMVEJLEDNING

Behandling i VP:

Et strakspreadvice forsøges altid makkersøgt med et strakspreadvice indrapporteret af den anden part ud fra følgende kriterier:

- anmelder skal være lig med modpartens handlet-med
- handelsdag skal være ens
- ISIN (skal være ens)
- mængde-tilgang-fragang-kode (skal være " modsat")
- mængde (skal være ens)
- beløb skal ligge inden for den tilladte tolerance på DKK 100,00 eller modværdien heraf i en anden valuta (NB. ved afvikling af handlen er det altid sælgers beløb, der anvendes som afregningsbeløb). Beløb kan være 0,00.
- valuta (skal være ens)

Hvis part-sub-ident-nummer er udfyldt, skal det være lig med modpartens modpart-sub-ident-nummer og omvendt.

Bemærk

Strakshandler, hvor betalingen ikke er blevet gennemført inden lukketiden for strakshandler, vil blive afvist. Afvikling af en strakshandel sker umiddelbart efter godkendelse af betalingen i Danmarks Nationalbank eller Den Europæiske Centralbank for afvikling i henholdsvis DKK og EUR. Afvikling af betalingsfri strakshandler sker umiddelbart efter beholdningskontrol.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 ANMELDELSE.	
03 AFSENDER-REFERENCE	F
02 PART-KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	F 1)
02 PART-KONTO. (VAERDIPAPIRKONTO)	
03 NUMMER	O
02 HANDLET-MED. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	F 2)
02 AFVIKLINGSDAG.	
03 AFVIKLINGSATO	F 3)
02 HANDELSPRODUKT.	
03 ISIN	O
02 STRAKSPREADVICE.	
03 MAENGDE-TILGANG-FRAGANG-KODE	O
03 MAENGDE	O
03 BELOEB	F 5)
03 PART-SUB-IDENT-NUMMER	F
03 MODPART-SUB-IDENT-NUMMER	F 4)
03 INTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 EKSTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 NAVNENOTERINGSKODE	F
03 FORCERMARKEKODE	F
03 HANDELSATO	O
03 BIC-PART-KI	F 1)
03 BIC-HANDLET-MED	F 2)
02 VALUTA.	



SYSTEMVEJLEDNING

03 ISO-KODE

F 5

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

1)	=	Enten PART-KI eller BIC-PART-KI skal være udfyldt
2)	=	Enten HANDLET-MED (Deltager-ID) eller BIC-HANDLET-MED skal være udfyldt
3)	=	AFVIKLINGSDATO kan kun være dags dato. Hvis feltet ikke udfyldes indsættes dags dato automatisk.
4)	=	Skal udfyldes ved handel med en CSD
5)	=	Kan være med eller uden pengebeløb. ISO-kode er obligatorisk, hvis pengebeløb >0

Annulering af preadvice (TU20005v)

Formål:

At annullere et tidligere indrapporteret preadvice.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- den oprindelige anmelder af preadvicet
- det kontoførende institut for den afgivende værdipapirkonto (KI)

Bemærk

- afsender-reference i annulleringstransaktionen skal være lig med afsender-referencen på det preadvice, der ønskes annulleret.

Hvis preadvicet er knyttet til en handel (begge parter har indrapporteret og instrueret), skal begge parter indrapportere en annulleringstransaktion.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Hvis preadvicet ikke er knyttet til en handel, annulleres preadvicet umiddelbart efter modtagelsen af annulleringstransaktionen, ellers annulleres de to preadvices først, når den sidste af parterne har indrapporteret sin annulleringstransaktion.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 OPRINDELIG-ANMELDER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.



SYSTEMVEJLEDNING

Annulering af instruct til preadvice (TU20006v)

Formål:

At annullere instruktionen til et preadvice.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- den oprindelige anmelder af preadvicet
- det kontoførende institut for den afgivende værdipapirkonto (KI)

Bemærk

- afsender-reference i annulleringstransaktionen skal være lig med afsender-referencen på det preadvice, hvortil instruktionen ønskes annulleret.

Annulering kan IKKE foretages, hvis preadvicet har fundet makker, og begge parter har indrapporteret instruktion (se evt. under "Annulering af preadvice").

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes annulleringstransaktionen, annulleres instruktionen umiddelbart efter modtagelsen. Samtidig blankstilles informationerne vedrørende gyldighedsperiodekode og forceringsmarkeringsskode på preadvicet.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 OPRINDELIG-ANMELDER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Ophævelse af kontantforbehold (TU20007v)

Formål:

At opnæve et kontantforbehold i en handel.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være den oprindelige anmelder af preadvicet på beholdningsfragangen.

Bemærk

- afsender-reference i ophævelsesstransaktionen skal være lig med afsender-referencen på det preadvice, hvorpå ophævelse af kontantforbehold ønskes foretaget.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.



SYSTEMVEJLEDNING

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, ophæves kontantforbeholdet umiddelbart efter modtagelsen.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 OPRINDELIG-ANMELDER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Etablering af instruct til preadvice (TU20008v)
Formål:

At ændre et preadvice til en endelig afviklingsinstruktion.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være den oprindelige anmelder af preadvice.

Bemærk

- afsender-reference i transaktionen skal være lig med afsender-referencen på det preadvice, der skal instrueres.
- hvis gyldighedsperiodekode ikke udfyldes, anvendes den for deltageren gældende defaultværdi.
- transaktionen vil blive afvist, hvis det preadvice, der skal instrueres, er knyttet til en handel (fundet makker) og handelen er knyttet til en igangværende afviklingskørsel.

Forcering:

Se beskrivelse i afsnit Forcering af transaktioner

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, ændres preadvice til en endelig afviklingsinstruktion umiddelbart efter modtagelsen af instruktionen.

Uddata:

Som udgangspunkt sendes der altid info-meddelelser til de involverede parter. Ved sammenfald imellem parterne udsendes ud fra følgende princip:

- | | |
|----------|---|
| TI20024v | 'Instructoplysninger til preadvice-anmelder' sendes til anmelder |
| TI20051v | 'Statusændring på preadvice' sendes kun til Kl, når Kl er forskellig fra anmelder |

Bemærk

I tilfælde af, at begge preadvices oprindeligt er indrapporteret uden instruct, vil infoerne

- | | |
|----------|--|
| TI20058v | 'Forventet bogføringsgrundlag - storkunde/indirekte clearingdeltager' og |
|----------|--|



SYSTEMVEJLEDNING

TI20060v 'Forventet bogføringsgrundlag - ikke-deltager'

først blive udsendt, når det sidste af de to preadvices er blevet instrueret.

DATAFELTER

02 OPRINDELIG-ANMELDER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 PREADVICE.	
03 GYLDIGHEDSPERIODEKODE	F
03 FORCERINGSMARKERINGSKODE	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP

Etablering af preadvice med brug af modparts oplysninger (TC20009v)

Formål:

At danne et preadvice med eller uden instruktion ud fra de oplysninger, der er angivet i modpartens oplysninger.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

Ved salg

- kontoførende institut for værdipapirkontoen
- et opdateringsrelateret kontoførende institut
- en fondshandler eller en storkunde med handelsfuldmagt.

Ved køb og hvor handelsbeløb er større end 0

- pengekontoførende institut (PK)
- et opdateringsrelateret pengekontoførende institut

Transaktionen kan kun anvendes, når preadvice er af typen "ikke handelsdeltager - handelsdeltager" (type 3) og "ikke handelsdeltager - ikke handelsdeltager" (type 4).

Forcering:

Se beskrivelse i afsnit Forcering af transaktioner

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, dannes det ønskede preadvice umiddelbart efter indrapporteringen.

Uddata:

Som udgangspunkt sendes der altid info-meddelelser til de involverede parter. Ved sammenfald imellem disse udsendes ud fra følgende principper:



SYSTEMVEJLEDNING

Beholdningssiden

Ved modtagelse:

Der sendes altid en info til anmelder (TI20022v) og der sendes info til handlet-med (TI20010v), hvis handlet-med er udfyldt, ellers sendes der til modpart-ki(TI20009v).

Når part er en handelsdeltager sendes info til handlet-for (TI20021v), hvis handlet-for er forskellig fra anmelder.

Når part er en ikke handelsdeltager sendes info til part-KI (TI20009v), hvis part-KI er forskellig fra anmelder.

Ved makkersøgning:

Der sendes info (TI20031v) til de samme parter som beskrevet ved modtagelse af preadvice.

Pengesiden

Ved modtagelse:

Det er kun ved salg til en ikke handelsdeltager, at der sendes info (TI20027v) til købers pengekontofører, som er den, der skal godkende betalingen.

Ved makkersøgning:

Hvis pengekontofører er forskellig fra Danmarks Nationalbank sendes der altid 1 info til partsidens pengekontofører.

Ved handel for en ikke handelsdeltager sendes info (TI20060v) og ved handel for en storkunde/-indirekte clearingdeltager sendes info (TI20058v).

De samme infoer som nævnt ved makkersøgning sendes ved:

- annullering af preadvice
- udskydelse af handel
- når handelen er klar til afvikling (begge sider er instrueret)
- udløb af et instruct

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 PART-IKKE-DELTAGER. (BETALINGSSTED)	
03 REGISTRERINGSNUMMER	F 1)
02 PREADVICE.	
03 PART-IKKE-DELTAGERS-PENGE-KTO	F 1)
03 INTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 EKSTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 NAVNENOTERINGSKODE	F
03 INSTRUCT-KODE	F
03 GYLDIGHEDSPERIODEKODE	F
03 FORCERMINGSMARKERINGSKODE	F
03 PANTERET-OENSKE-KODE	F 2)
02 RELATERET-ANMELDER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 RELATERET-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O



SYSTEMVEJLEDNING

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

- 1) = skal udfyldes v. handelsbeløb > 0 hvis registreringsnummer og modpart-ikke-deltagers-pengekonto ikke er udfyldt på det oprindelige preadvice
- 2) = må kun anvendes når preadvice er en tilgang til en VP-konto af typen ikke-afviklingsansvarlig (AI, UI, PR) og handelsbeløb > 0 (handelen er med pengeclearing)

Navnenotering/afnotering af beholdning (TU20011v)

Formål:

At navnenotere eller afnotere en værdipapirbeholdning.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være kontoførende institut (KI) for værdipapirkontoen eller et opdateringsrelateret kontoførende institut.

Bemærk

- navnenotering kan kun foretages, hvis det på handelsproduktet er angivet, at navnenotering må foretages.

Det angives i anmeldelsestype om transaktionen er en navnenotering eller en afnotering.

Ved navnenotering skal den beholdning, der ønskes navnenoteret, være mindre end eller lig med den ikke navnenoterede beholdning.

Ved afnotering skal den beholdning, der ønskes afnoteret, være mindre end eller lig med den navnenoterede beholdning.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendte transaktioner behandles umiddelbart efter indrapporteringen.

Transaktionen afvises, hvis ISIN er udelukket på indrapporteringstidspunktet eller

- hvis manglende dækning i beholdning eller
- manglende dækning i noteret beholdning.
- der forsøges afnotering på en ISIN der er markeret for pligtig navnenotering i fondsregisteret.

Uddata:

Som udgangspunkt sendes der altid info-meddelelser til de involverede parter. Ved sammenfald imellem parterne udsendes ud fra følgende princip:

- | | |
|----------|---|
| TI20032v | navnenotering/afnotering foretaget sendes altid til KI og desuden til anmelder, hvis denne er forskellig fra KI |
| TI20047v | status på beholdning sendes altid til KI |
| TI20240v | status på navnenotering sendes til anmelder. |

DATAFELTER

02 ANMELDELSE.	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 ANMELDELESTYPE.	

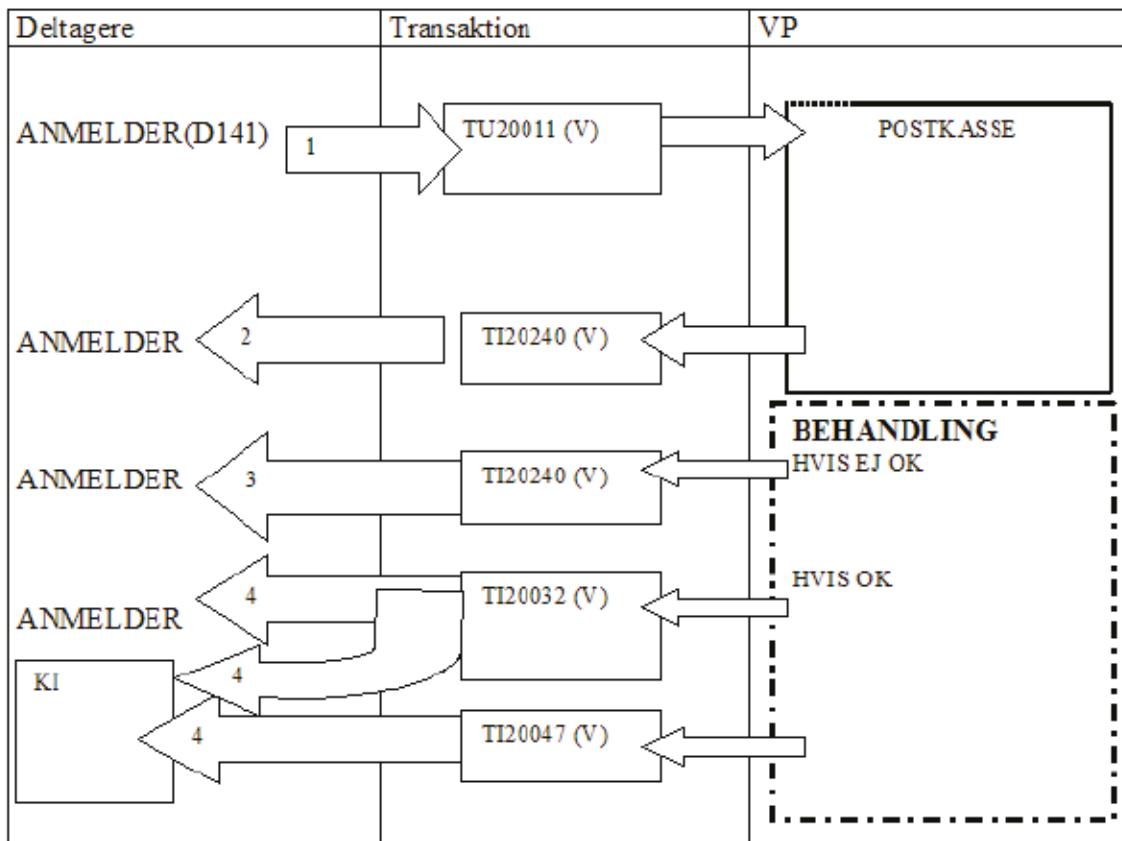


SYSTEMVEJLEDNING

03 KODE	O
02 KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VAERDIPAPIRKONTO.	
03 NUMMER	O
02 HANDELSPRODUKT.	
03 ISIN	O
02 NAVNENOTERINGSANMODNING.	
03 MAENGDE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive sat ved modtagelsen i VP.



Forklaring:

1.	Transaktionen indsendes og lægges i postkassen.		
2.	Info TI20240(V) Status på navnenotering sendes til anmelder med:		
	Status	=	15 Anmeldelse klar til afvikling og
	Årsagskode	=	4 Validering foretaget eller
		=	9 Angivne ISIN er udelukket fra afvikling eller



SYSTEMVEJLEDNING

	=	23	Afviklingskørsel er påbegyndt.
3.	Hvis efterfølgende behandling ikke er OK, sendes TI20240(V) Status på navnenotering med:		
	Status	=	10 Anmeldelse afvist og
	Årsagskode	=	29 Manglende dækning i noteret beholdning eller
		=	1 Manglende dækning i beholdning eller
		=	9 Angivne ISIN er udelukket fra afvikling.
4.	Hvis behandling er OK, sendes TI20032(V) Navnenotering/afnotering foretaget til anmelder og kontoførende institut som kvittering på den foretagne behandling, og TI20047(V) Status på beholdning sendes til kontoførende institut for at informere om status på beholdning efter ændringen. Samtidig ændres status og årsagskode til:		
	Status	=	9 Anmeldelse afviklet og
	Årsagskode	=	5 Transaktion gennemført.

Opdatering af trækningsmaksimum - indirekte pengeclearingdeltager (TU20012v)

Formål:

At opdatere beløb på et basis-trækningsmaksimum eller at opdatere beløb samt andre oplysninger på et specifikt trækningsmaksimum.

Basis-trækningsmaksimum:

Et basis-trækningsmaksimum er afgivet af en primær betalingsstiller og benyttes til afvikling af handler i den valuta, som det er afgivet i, samt til afvikling af handler i andre valutaer, hvori der ikke er afgivet et specifikt trækningsmaksimum.

Et basis-trækningsmaksimum benyttes kun til handelsafvikling.

Der skal altid findes et basis-trækningsmaksimum til brug for handelsafvikling.

Ændring af valuta på basis-trækningsmaksimum:

Ændring af valuta på basis-trækningsmaksimummet meddeles VP på blanket 2.2.G Erklæring om betalingsstillelse for pengekonti som findes i "Blanketter til vejledninger". Når VP gennemfører ændringen, vil basis-trækningsmaksimummet i den tidligere valuta blive ændret til et specifikt trækningsmaksimum. Derudover vil det blive lukket, og beløb (maksimum) samt påvirkning vil blive nulstillet.

Efter ændringen kan den primære betalingsstiller indtaste beløb (maksimum) på det nye basis-trækningsmaksimum i den nye valuta.

Hvis der allerede findes et specifikt trækningsmaksimum i den valuta, som fremover skal være basis-trækningsmaksimummets valuta, vil beløb (maksimum) og påvirkning på dette blive nulstillet i forbindelse med ændringen.

Specifikt trækningsmaksimum:

Et specifikt trækningsmaksimum er afgivet af en primær betalingsstiller og benyttes kun i forudbestemte afviklingsblokke og i den valuta, som det er afgivet i.

Specifikke trækningsmaksima skal altid benyttes til periodisk afvikling.

Specifikke trækningsmaksima kan benyttes til handelsafvikling, hvis den primære betalingsstiller ønsker at begrænse trækket i en bestemt valuta.

Specifikke trækningsmaksima oprettes efter behov.



SYSTEMVEJLEDNING

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være afgiver af trækningsmaksimummet og være oprettet som primær betalingsstiller (BS).

Kun primære betalingsstillerne kan stille et trækningsmaksimum til rådighed for en indirekte pengeclearingdeltager.

Det skal angives, om opdateringen vedrører et basis-trækningsmaksimum eller et specifikt trækningsmaksimum.

Beløbet angives i den aktuelle valuta.

Gælder kun specifikke trækningsmaksima:

- Udløbsdato kan angives. Trækningsmaksimummet er gældende til og med den angivne udløbsdato, hvorefter det lukkes. Indrapporteres et nyt trækningsmaksimum (beløb), inden det forrige udløber, vil det nye beløb være gældende.
- Status kan angives (2=aktiv eller 5=lukket). Hvis et specifikt trækningsmaksimum lukkes, vil handler i maksimummets valuta blive pengekontrolleret under basis-trækningsmaksimummet.
- De bloknumre, det specifikke trækningsmaksimum må benyttes i, skal angives. Der skal altid angives mindst ét bloknummer.

Indholdet i transaktionen skal betragtes som de fremtidigt gældende oplysninger. Hvis et specifikt trækningsmaksimum f.eks. ikke længere må benyttes i bloknummer 40, skal transaktionen indeholde alle de andre oplysninger, der stadigvæk skal være gældende (f.eks. beløb og udløbsdato), samt de bloknumre, som det specifikke trækningsmaksimum fremover gerne må benyttes i.

VP-standardsystem:

D140 kan anvendes.

Bemærk

Et trækningsmaksimum kan ikke opdateres under en afviklingskørsel med samme pengeclearingstype som trækningsmaksimummet.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter.

Behandling i VP:

Godkendte transaktioner opdateres i deltagerregistret umiddelbart efter modtagelsen.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelse:

TI20039v Opdateret trækningsmaksimum – indirekte pengeclearingdeltager (til såvel afgiver som modtager af trækningsmaksimum).

DATAFELTER

02 PENGETRAEK-AFGIVER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 PENGETRAEK-MODTAGER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 PENGE-CLEARINGS-TYPE.	
03 KODE	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 TRAEK-MAKS-INDIREKT-CLEARINGDELT	



SYSTEMVEJLEDNING

03 TRAEKNINGSMAXIMUMS-BELOEB	O
03 STATUS	F
03 TYPE	O
03 UDLOEBSDATO	F
02 TRAEK-MAKS-IND-CLEARDELT-BLK-ANV	
03 KOERSELS-BLOK-NUMMER	O
03 KOERSELS-BLOK-NUMMER	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Oprettelse af specifikt trækningsmaksimum - indirekte pengeclearingdeltager (TC20012v)

Formål:

At oprette et specifikt trækningsmaksimum til en indirekte pengeclearingdeltager.

Specifikt trækningsmaksimum:

Et specifikt trækningsmaksimum er afgivet af en primær betalingsstiller og benyttes kun i forudbestemte afviklingsblokke og i den valuta, som det er afgivet i.

Specifikke trækningsmaksima skal altid benyttes til periodisk afvikling.

Specifikke trækningsmaksima kan benyttes til handelsafvikling, hvis den primære betalingsstiller ønsker at begrænse trækket i en bestemt valuta.

Specifikke trækningsmaksima oprettes efter behov.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være afgiver af trækningsmaksimummet og være oprettet som primær betalingsstiller (BS).

Kun primære betalingsstillere kan stille et trækningsmaksimum til rådighed for en indirekte pengeclearingdeltager.

Det skal angives, at opdateringen vedrører et specifikt trækningsmaksimum.

Beløbet angives i den aktuelle valuta.

Udløbsdato kan angives. Trækningsmaksimummet er gældende til og med den angivne udløbsdato, hvorefter det lukkes.

Status kan angives (2=aktiv eller 5=lukket). Hvis et specifikt trækningsmaksimum lukkes, vil handler i maksimummets valuta blive pengekontrolleret under basistrækningsmaksimummet.



SYSTEMVEJLEDNING

De bloknumre, det specifikke trækningsmaksimum må benyttes i, skal angives. Der skal altid angives mindst ét bloknummer.

VP-standardsystem:
D140 kan anvendes.

Bemærk

Et trækningsmaksimum kan ikke opdateres under en afviklingskørsel med samme pengeclearingstype som trækningsmaksimummet.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se datafelter.

Behandling i VP:

Godkendte transaktioner opdateres i deltagerregistret umiddelbart efter modtagelsen.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelse:

TI20039v Opdateret trækningsmaksimum – indirekte pengeclearingdeltager
(til såvel afgiver som modtager af trækningsmaksimum).

DATAFELTER

02 PENGETRAEK-AFGIVER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 PENGETRAEK-MODTAGER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 PENGE-CLEARINGS-TYPE.	
03 KODE	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 TRAEK-MAKS-INDIREKT-CLEARINGDELT	
03 TRÆKNINGSMAXIMUMS-BELOEB	O
03 STATUS	F
03 TYPE	O
03 UDLOEBSDATO	F
02 TRAEK-MAKS-IND-CLEARDELT-BLK-ANV	
03 KOERSELS-BLOK-NUMMER	O
03 KOERSELS-BLOK-NUMMER	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.



SYSTEMVEJLEDNING

Etablering af multioverførsel (TC20013v)

Formål:

At overføre alle beholdninger fra en værdipapirkonto til en anden.

Behandling hos centraldeltager:

Transaktionen indrapporteres af det afgivende kontoførende institut (KI) eller af et opdateringsrelateret afgivende KI.

Bemærk

Såfremt overførslen bliver gennemført vil den få retsvirkning fra det tidspunkt (accepttidspunkt), der er angivet i OK-svaret på transaktionen.

Eventuel indberetning til Danmarks Nationalbank af en overførsel mellem en valutaindlændning og en valutaudlændning skal foretages af det kontoførende institut, der fører værdipapirkontoen for valutaindlændningen.

Transaktionen afvises hvis det er en multioverførsel til en Link Up CSD, se Forretningsmæssig vejledning, Clearingvejledning Link Up-Markets.

Forcering:

Se beskrivelse i afsnit Forcering af transaktioner

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter.

Behandling i VP:

Godkendte transaktioner opdateres på de involverede værdipapirkonti umiddelbart efter modtagelsen.

Transaktionen afvises, hvis der på "fra" værdipapirkonto findes blot én af følgende:

- reserverede beholdninger
- beholdninger hvor på der er registreret panteret
- beholdninger, hvor på der er taget kontantforbehold
- eller ISIN's, som er omfattet af en udelukkelse

Transaktionen afvises, hvis enten "fra" eller "til" værdipapirkontoen indgår i en sikkerhedsretsaftale.

Uddata:

Som udgangspunkt sendes der altid info-meddelelser til de involverede parter. Ved sammenfald imellem disse udsendes ud fra følgende princip:

- | | |
|----------|---|
| TI20011v | overførselsoplysninger sendes til anmelder (uden ISIN-oplysninger) |
| TI20050v | afviklet overførsel sendes til anmelder |
| TI20016v | afviklet overførsel sendes altid til KI pr. beholdning *) (også når KI er lig med anmelder) |
| TI20047v | status på beholdning sendes altid til KI pr. beholdning *) |

*) hvis en delmængde af beholdningen er udtrukket/navnenoteret, sendes en info for den udtrukne/navnenoterede del og en info for den ikke udtrukne/navnenoterede del

Ved avisning af en overførsel sendes info:

- | | |
|----------|-------------------------------------|
| TI20053v | avisning af overførsel til anmelder |
|----------|-------------------------------------|



SYSTEMVEJLEDNING

DATAFELTER (TC200131)

02 ANMELDELSE.	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 AFGIVER-KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 AFGIVER-KONTO. (VAERDIPAPIRKONTO)	
03 NUMMER	O
02 MODTAGER-KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 MODTAGER-KONTO. (VAERDIPAPIRKONTO)	
03 NUMMER	O
02 MULTI-OVERFOERSEL. (OVERFOERSEL)	
03 MODTAGER-SUB-IDENT-NUMMER	F *)
03 INTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 EKSTERN-POSTERINGSTEKST	F
03 REFERENCENUMMERSKIFT-KODE	F
03 FORCERMARKEKODE	F

O = obligatorisk, F = frivillig, *) = skal udfyldes ved overførsel til en CSD

OBS: Det er ikke muligt at etablere overførsler til Link Up CSD'er.

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Etablering af supplerende oplysninger til en tidligere indsendt anmeldelse (TC20014v)

Formål:

At oplyse om den oprindelige afgiver og/eller den endelige modtager af en overført eller handlet værdipapirbeholdning.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være den oprindelige anmelder af den anmeldelse, som de supplerende oplysninger vedrører.

Bemærk

- afsender-reference i transaktionen skal være lig med afsender-referencen på den tidligere indsendte anmeldelse.
- efter opdatering i VP kan en supplerende oplysning ikke ændres

Transaktionen kan anvendes, hvis den endelige modtager eller den oprindelige afgiver er en anden end den, der fremgår af den oprindelige anmeldelse.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendte transaktioner opdateres umiddelbart efter modtagelsen.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER



SYSTEMVEJLEDNING

02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 SUPPLERENDE-OPLYSNINGER.	
03 MODTAGER-KONTONUMMER	F
03 MODTAGER-ID-1	F
03 MODTAGER-ID-2	F
03 MODTAGER-ID-3	F
03 MODTAGER-ID-4	F
03 AFGIVER-KONTONUMMER	F
03 AFGIVER-ID-1	F
03 AFGIVER-ID-2	F
03 AFGIVER-ID-3	F
03 AFGIVER-ID-4	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Etablering af instruct til strakspreadvice (TU20015v)

Formål:

At reinstruere et strakspreadvice. Der kan kun være tale om en reinstruktion, da et strakspreadice er født instrueret. Den medføgte instruktion kan dog afvises i forbindelse med en dækningskontrol, hvorfor det kan være nødvendigt at reinstruere.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være oprindelig anmelder af strakspreadvicet.

Bemærk

- afsender-reference i transaktionen skal være lig med afsender-referencen på det strakspreadvice, der skal reinstrueres.

Forcering:

Se beskrivelse i afsnit Forcering af transaktioner

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, ændres straksspreadvicet til en endelig afviklingsinstruktion umiddelbart efter modtagelsen af instruktionen.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE).	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 PREADVICE.	
03 FORCERMARKEKODER	F

O = obligatorisk, F = frivillig



SYSTEMVEJLEDNING

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Anmodning om beholdningsudtræk - batch (TC20016v)

NB. Transaktionen er p.t. inaktiv hvorfor beholdningsudtræk indtil videre skal rekvireres ved skriftlig henvendelse til Clearing & Custody Services.

Formål:

At anmode om oplysning om aktuel beholdning på et interval af værdipapirkonti/ISIN's efter en afviklingskørsel.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være aftalehaverens datacenter (DC).

Bemærk

- ønsket afviklingsdato skal være større end eller lig med aktuel afviklingsdato
- ønsket afviklingskørsel skal være fremtidig

Udtrækket kan rekvireres på følgende niveauer:

- pr. datacenter (DC)
- pr. aftalehaver(AH)
- pr. kontoførende institut (KI)

For hvert niveau kan vælges, om det skal være:

- samtlige konti eller et interval af konti
- samtlige ISIN's eller et interval af ISIN's

Det er muligt at angive i transaktionen (opdaterings-tidspunkt-for-maengde), at der kun ønskes beholdningsoversigter på konti, hvorpå der er sket beholdningsændringer efter et angivet tidspunkt.

Eksempel:

Hvis der i feltet angives 19951115120000000000, så er det kun værdipapirkonti, hvorpå der er foretaget ændringer efter den 15/11 1995 kl. 11.5999999999, der medtages i udtrækket.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, sendes den ønskede information efter den angivne afviklingskørsel. Der sendes kun oplysninger om beholdning, hvis beholdningen er større end 0.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 REKVISITION.	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 AFTALEHAVER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	F
02 KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	F 1)
02 REKVISITIONSOPLYSNINGER.	



SYSTEMVEJLEDNING

03 SOEG-FRA-KONTONUMMER	F 2)
03 SOEG-TIL-KONTONUMMER	F 2)
03 SOEG-FRA-ISIN	F
03 SOEG-TIL-ISIN	F
02 BEHOLDNING-SIDST-OPDATERET.	
03 OPDATERINGSTIDSPUNKT-FOR-MAENGDE	F
02 OENSKESET-AFVIKLINGS DAG. (AFVIKLINGS DAG)	
03 AFVIKLINGS-DATO	O
02 OENSKESET-AFVIKLINGSBLOK.	
03 KOERSELSBLOK	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

- 1) = skal udfyldes, hvis SOEG-FRA-KONTONUMMER eller SOEG-TIL-KONTONUMMER anvendes
- 2) = kan kun anvendes, hvis Kl-identifikation er udfyldt

Anmodning om beholdningsudtræk - online (TR20017v)

Formål:

At anmode om oplysning om beholdningen i et interval af ISIN's på en given værdipapirkonto.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- kontoførende institut for værdipapirkontoen
- et spørge-/opdateringsrelateret kontoførende institut
- storkunde for egne værdipapirkonti
- registreret med en spørge-/handelsfuldmagt

Der kan vælges mellem samtlige ISIN's på værdipapirkontoen eller et interval af ISIN's.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, sendes den ønskede information umiddelbart efter modtagelsen. Der sendes kun oplysninger om beholdning, hvis beholdningen er større end 0.

Uddata:

NB. Det er kun hvis anmodningen indsendes som en system-system transaktion at der dannes info-meddelelser.

DATAFELTER

02 KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VAERDIPAPIRKONTO.	
03 NUMMER	O
02 ISIN-INTERVAL-START. (HANDELSPRODUKT)	
03 ISIN	F
02 ISIN-INTERVAL-SLUT. (HANDELSPRODUKT)	
03 ISIN	F



SYSTEMVEJLEDNING

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Anmodning om ikke afviklede preadvices - batch (TC20018v)

Formål:

At anmode om oplysning om ikke afviklede preadvices efter en afviklingskørsel.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være aftalehaverens datacenter (DC).

Bemærk

- ønsket afviklingsdato skal være større end eller lig med aktuel afviklingsdato
- ønsket afviklingskørsel skal være fremtidig

Udtrækket kan rekvireres på følgende niveauer:

- pr. datacenter (DC)
- pr. aftalehaver(AH)
- pr. kontoførende institut (KI)

For hvert niveau kan vælges, om det skal være:

- samtlige konti eller et interval af konti
- samtlige ISIN's eller et interval af ISIN's

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, sendes den ønskede information efter den angivne afviklingskørsel.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 REKVISITION.		
03 AFSENDER-REFERENCE	O	
02 AFTALEHAVER. (DELTAGER)		
03 IDENTIFIKATION	F	
02 KI. (DELTAGER)		
03 IDENTIFIKATION	F	
02 REKVISITIONSOPLYSNINGER.		
03 SOEG-FRA-KONTONUMMER	F	
03 SOEG-TIL-KONTONUMMER	F	
03 SOEG-FRA-ISIN	F	
03 SOEG-TIL-ISIN	F	
02 OENSKET-AFVIKLINGSDAG. (AFVIKLINGSDAG)		
03 AFVIKLINGSATO	O	
02 OENSKET-AFVIKLINGSBLOK. (AFVIKLINGSKOERSEL)		
03 KOERSELSBLOK	O	



SYSTEMVEJLEDNING

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Anmodning om ikke afviklede preadvices - online (TR20019v)

Formål:

At anmode om oplysning om ikke afviklede preadvices i et interval af ISIN's på en given værdipapirkonto.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- anmelder af det/de ikke afviklede preadvice(s)
- kontoførende institut (KI) for værdipapirkontoen
- et opdateringsrelateret kontoførende institut
- registreret med en spørge-/handelsfuldmagt

Bemærk

Hvis anmelder er kontoførende institut eller opdateringsrelateret kontoførende institut, vises samtlige ikke afviklede preadvices til værdipapirkontoen. I modsat fald vises kun de ikke afviklede preadvices, som anmelderen selv har indrapporteret.

Der kan vælges mellem samtlige ISIN's på værdipapirkontoen eller et interval af ISIN's.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, sendes den ønskede information umiddelbart efter modtagelsen.

Uddata

NB. Det er kun hvis anmodningen indsendes som en system-system transaktion, at der dannes info-meddelelser.

DATAFELTER

02 KI. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VAERDIPAPIRKONTO.	
03 NUMMER	O
02 ISIN-INTERVAL-START. (HANDELSPRODUKT)	
03 ISIN	F
02 ISIN-INTERVAL-SLUT. (HANDELSPRODUKT)	
03 ISIN	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Annulering af strakspreadvise (TU20020v)

Formål:

At annullere et tidligere indrapporteret strakspreadvise.



SYSTEMVEJLEDNING

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- den oprindelige anmelder af strakspreadicet
- det kontoførende institut (PART-KI).

Bemærk

- afsender-reference i annulleringstransaktionen skal være lig med afsender-referencen på det strakspreadice, der ønskes annulleret.

Straksspreadicet kan IKKE annulleres, hvis det har fundet makker, og begge sider er klar til afvikling.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, annulleres straksspreadicet umiddelbart efter modtagelsen.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 OPRINDELIG-ANMELDER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive sat ved modtagelsen i VP.

Sletning af rekvisition (TD20025v)
Formål:

At slette en tidligere indrapporteret rekvisition af typerne:

- "Anmodning om beholdningsudtræk - batch (TC20016v)",
- "Anmodning om beholdningsudtræk pr. døgnskift - batch (TC20301v)" eller
- "Anmodning om ikke afviklede preadvices - batch (TC20018v)"

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være den oprindelige anmelder af rekvisitionen.

Bemærk

- afsender-reference i slettetransaktionen skal være lig med afsender-referencen på den rekvisition, der ønskes slettet.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, annulleres rekvisitionen umiddelbart efter modtagelsen.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.



SYSTEMVEJLEDNING

DATAFELTER

02 REKVISITION.	
03 AFSENDER-REFERENCE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Anmodning om oversigt over fuldmagter - (TR20094v)

Formål:

At få oplysning om på hvilke konti der er registreret fuldmagter til anmelderen.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være en deltager, der har fået registreret fuldmagter hos andre kontoførende institutter.

Udtrækket kan rekviseres på følgende niveauer:

- alle fuldmagter (ingen felter udfyldes)
- alle fuldmagter pr. KI (KI-INTERVAL-START og KI-INTERVAL-SLUT udfyldes)
- et interval af fuldmagter (alle felter udfyldes)

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, sendes den ønskede information.

Uddata:

NB. Det er kun hvis anmodningen indsendes som en system-system transaktion at der dannes info-meddelelser til anmelder (TI20079v).

DATAFELTER

02 KI-INTERVAL-START. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	F
02 KONTONUMMER-INTERVAL-START	
03 NUMMER	F
02 KI-INTERVAL-SLUT. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	F
02 KONTONUMMER-INTERVAL-SLUT.	
03 NUMMER	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.



SYSTEMVEJLEDNING

Anmodning om beholdningsudtræk pr. døgnskift - batch (TC20301v)

NB. Transaktionen er p.t. inaktiv hvorfor beholdningsudtræk indtil videre skal rekvireres ved skriftlig henvendelse til Clearing & Custody Services

Formål:

At anmode om oplysning om aktuel beholdning på et interval af værdipapirkonti/ISIN's pr. døgnskift.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være aftalehaverens datacenter (DC).

Bemærk

- hvis der indsendes en rekvision, der i indhold er identisk med en, der allerede er modtaget, så vil den blive afvist, uanset om de 2 rekvitioner har forskellig afsender-reference eller ej.

Udtrækket kan rekvireres på følgende niveauer:

- pr. datacenter (DC)
- pr. aftalehaver(AH)
- pr. kontoførende institut (KI)

For hvert niveau kan vælges, om det skal være:

- samtlige konti eller et interval af konti
- samtlige ISIN's eller et interval af ISIN's

I transaktionen angives pr. hvilken afviklingsdag udtrækket ønskes (udtræk-pr-afviklingsdag). Infoen vil vise afviklingsdøgnets slutbeholdning.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, sendes den ønskede information i forbindelse med skift til nyt afviklingsdøgn
Der sendes kun oplysninger om beholdning, hvis beholdningen er større end 0.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.

DATAFELTER

02 REKVISITION.		
03 AFSENDER-REFERENCE	O	
02 UDTRAEK-PR-AFVIKLINGS DAG. (AFVIKL.DAG)		
03 AFVIKLINGS-DATO	O	
02 AFTALEHAVER. (DELTAGER)		
03 IDENTIFIKATION	F	
02 KI. (DELTAGER)		
03 IDENTIFIKATION	F	
02 REKVISITIONSOPLYSNINGER.		
03 SOEG-FRA-KONTONUMMER	F	
03 SOEG-TIL-KONTONUMMER	F	
03 SOEG-FRA-ISIN	F	
03 SOEG-TIL-ISIN	F	

O = obligatorisk, F = frivillig



SYSTEMVEJLEDNING

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Flyt PVP-engagementer til likviditetsstiller (TC20334v)

Formål:

At flytte en nødlidende deltagers engagement i en PVP-afvikling til den aktive likviditetsstiller.

Behandling hos garantiagent:

Transaktionen indrapporteres af likviditetsstilleren, der herved tilkendegiver overtagelse af nødlidende deltagers forpligtelser i PVP-afviklingen. Likviditetsstilleren overtager hele den nødlidende deltagers forpligtelser, ikke kun det manglende beløb. Til gengæld overtager likviditetsstilleren den nødlidende deltagers rettigheder i PVP-afviklingen.

VP-standardsystem:

D324 kan anvendes.

Behandling i VP:

Nødlidende deltagers forpligtelser overført til likviditetsstiller.

Kun den aktive likviditetsstiller kan anvende transaktionen og kun når der er konstateret manglende dækning efter 2. pengekontrol.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20083v	Specifikation af beløb overført til likviditetsstiller (til betalingsstilleren)
TI20081v	Specifikation af beløb overført til likviditetsstiller (til likviditetsstiller)

DATAFELTER (TC200131)

02 LIKVIDITETSSTILLER (DISS-DATA)	
03 ACCEPTER-FLYTNING-TIL-GS	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Forespørgsel på VP's basisregister over udenlandske værdipapirer (TR20368v)

Formål:

At vise de udenlandske ISINs, der er overført til VP via et link, og som er registreret i VP's basisregister.

Behandling hos deltageren:

Transaktionen er tilgængelig for alle aktive VP-deltagere.

VP-standardsystem:

D152 kan anvendes.

Behandling i VP:

Ingen.



SYSTEMVEJLEDNING

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelse:

TI20174v Udenlandske værdipapirer i VP's basisregister.

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Forespørgsel på deltagerens papirfilter over udenlandske værdipapirer (TR20369v)

Formål:

At vise de udenlandske ISINs, der er overført via et link til VP, med samtidig automatisk registrering i den enkelte deltagers papirfilter.

Behandling hos deltageren:

Anmelderen af transaktionen skal være AH, KI, PK, FH eller ST. Der kan spørges på eget papirfilter og på andre deltageres papirfiltre.

VP-standardsystem:

D153 kan anvendes. Der kan vises 60 ISINs ad gangen. Hvis der er mere end 60 ISINs udfyldes START-FRA-ISIN med ISIN for den sidst viste. ISO-LANDEKODE angives, hvis ISINs med et bestemt hjemland ønskes vist.

Behandling i VP:

Ingen.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelse:

TI20175v Udenlandske værdipapirer i deltagerens papirfilter

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER	
03 IDENTIFIKATION	O
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	/
02 START FRA ISIN.(HANDELSPRODUKT)	
03 ISIN	F
02 LAND	
03 ISO-KODE	F

O = obligatorisk, F = frivillig / = Må ikke udfyldes



SYSTEMVEJLEDNING

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Sletning af udenlandske værdipapirer i eget papirfilter (TD20369v)

Formål:

At fjerne de udenlandske værdipapirer fra eget papirfilter, som deltageren ønsker at være kontoførende for.

Behandling hos deltageren:

Transaktionen er alene tilgængelig for aftalehavere. Ved system til system transaktion udfyldes tillige ISIN, medens START-FRA-ISIN og LAND ikke udfyldes.

VP-standardsystem:

D153 kan anvendes. Sletning foretages ved at afkrydse de ISINs, som ønskes slettet fra eget papirfilter.

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at anmelder af transaktionen er aftalehaver for deltageren.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelse:

TI20226v Sletning af udenlandske værdipapirer i deltagerens papirfilter

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER	
03 IDENTIFIKATION	O
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	O
02 START FRA ISIN.(HANDELSPRODUKT)	
03 ISIN	/
02 LAND	
03 ISO-KODE	/

O = obligatorisk, F = frivillig / = Må ikke udfyldes

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Etablering af udenlandske værdipapirer i eget papirfilter (TC20380v)

Formål:

At oprette udenlandske værdipapirer i deltagerens eget papirfilter, som deltageren ikke længere ønsker at være kontoførende for.

Behandling hos deltageren:

Anmelder af transaktionen skal være aftalehaver.

VP-standardsystem:

D154 kan anvendes.



SYSTEMVEJLEDNING

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at anmelder af transaktionen er aftalehaver for deltageren.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddeelse:

TI20170v Nyt udenlandsk værdipapir i deltagerens papirfilter

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	<input checked="" type="checkbox"/>
02 DELTAGER	
03 IDENTIFIKATION	<input checked="" type="checkbox"/>
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	<input checked="" type="checkbox"/>

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive isat ved modtagelsen i VP.

Anmodning om beholdningsudtræk til storkunder pr. døgnskift - batch (TC20234v)

Formål:

At anmode om oplysning om aktuel beholdning på en eller flere værdipapirkonti tilhørende en storkunde.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være aftalehaverens datacenter (DC).

Bemærk

- hvis der indsendes en rekvisition, der i indhold er identisk med en, der allerede er modtaget, så vil den blive afvist, uanset om de 2 rekvisitioner har forskellig afsender-reference eller ej.

Udtrækket kan rekvireres på følgende niveauer:

- pr. datacenter (DC)
- pr. aftalehaver(AH)
- pr. kontoførende institut (KI)

For hvert niveau kan vælges, om det skal være:

- samtlige konti eller en specifik konto
- samtlige ISINs eller et interval af ISINs

I transaktionen angives, pr. hvilken afviklingsdag udtrækket ønskes (udtræk-pr-afviklingsdag). Infoen vil vise afviklingsdøgnets slutbeholdning.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes transaktionen, sendes den ønskede information i forbindelse med skift til nyt afviklingsdøgn. Der sendes kun oplysninger om beholdning, hvis beholdningen er større end 0.



SYSTEMVEJLEDNING

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20065v

Oversigt over beholdning på en værdipapirkonto pr. døgnskift – (ST) (DC)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE.		
03 AFSENDER-REFERENCE	O	
02 UDTRAEK-PR-AFVIKLINGSDAG. (AFVIKL.DAG)		
03 AFVIKLINGS-DATO	O	
02 AFTALEHAVER. (DELTAGER)		
03 IDENTIFIKATION	F	
02 KI. (DELTAGER)		
03 IDENTIFIKATION	F	
02 REKVISITIONSOPLYSNINGER.		
03 SOEG-FRA-KONTONUMMER	F	
03 SOEG-FRA-ISIN	F	
03 SOEG-TIL-ISIN	F	

O = obligatorisk, F = frivillig

Ved manglende udfyldelse af et frivilligt felt, der har en defaultværdi (se feltbeskrivelser), vil denne blive sat ved modtagelsen i VP.

Annulling af instruct til preadvice i forbindelse med buy-in (TU20191v)

Formål:

At annullere instruktionen til et preadvice i henhold til de gældende buy-in regler fra OMX.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- den oprindelige anmelder af preadvice
- det kontoførende institut for den afgivne værdipapirkonto (KI)

Bemærk

- afsender-reference i annullingstransaktionen skal være lig med afsender-referencen på det preadvice, hvortil instruktionen ønskes annulleret.

Transaktionen må kun anvendes når en køber af aktier i henhold til de gældende buy-in regler fra OMX ønsker at trække sig ud af en handel.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

Behandling i VP:

Godkendes annullingstransaktionen, annulleres instruktionen umiddelbart efter modtagelsen. Samtidig blankstilles informationerne vedrørende gyldighedsperiodekode og forceringsmarkeringsskode på preadvice.

Uddata:

Der dannes info-meddelelser til de involverede parter.



SYSTEMVEJLEDNING

DATAFELTER

02 OPRINDELIG-ANMELDER. (DELTAGER)	
03 IDENTIFIKATION	O
02 OPRINDELIG-ANMELDELSE. (ANMELDELSE)	
03 AFSENDER-REFERENCE	O

O = obligatorisk, F = frivillig

Oprettelse af egenbeholdningsdepot (TC20451v)

Formål:

At registrere et depot som egenbeholdningsdepot i relation til beholdningssanktionering.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- det kontoførende institut for den afgivne værdipapirkonto (KI)

Fondshandleres og storkunders egenbeholdningsdepoter kan registreres med virkning for beholdningssanktionering. For sent inrapporterede salg fritages for beholdningssanktionering, når handlen foregår mellem to af deltagerens egne egenbeholdningsdepoter, der er registreret som tilhørende deltageren. Bemærk, at der kan registreres sub-ident-nummer således at handler mod eget sub-ident-nummer i f.eks. Euroclear Bank kan behandles som handler mellem egne egenbeholdningsdepoter. Det er fondshandlerens eller storkundens ansvar at sikre sig, at registreringen finder sted via det kontoførende institut.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

VP-standardsystem:

D312 anvendes.

Behandling i VP:

Godkendte inrapporteringer af værdipapirkontonumre opdateres i register over egenbeholdningsdepoter til brug for beholdningssanktionering.

Uddata:

Ingen.

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 EGENBEHOLDNINGSDEPOT	
03 KI-IDENTIFIKATION	O
03 VAERDIPAPIRKONTONUMMER	O
03 SUB-IDENT-NUMMER	F
03 AH-EJER-IDENTIFIKATION	O

O = obligatorisk, F = frivillig



SYSTEMVEJLEDNING

Forespørgsel på egenbeholdningsdepot (TR20451v)

Formål:

At vise depoter der er registreret som egenbeholdningsdepoter i relation til beholdningssanktionering.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- det kontoførende institut for den afgivne værdipapirkonto (KI).
- fondshandler/storkunde der er registreret som ejer af et egenbeholdningsdepot.

Vis (F02)

Det kontoførende institut eller den registrerede ejer kan få vist depoter registreret som egenbeholdningsdepoter. AH-ejer-identifikation, KI-identifikation, værdipapirkontonummer og evt. sub-ident-nummer skal angives.

Man kan således få at vide om et depot er registreret som egenbeholdningsdepot.

List (F04)

Det kontoførende institut eller den registrerede ejer kan få listet depoter registreret som egenbeholdningsdepoter. AH-ejer-identifikation, KI-identifikation, værdipapirkontonummer og evt. sub-ident-nummer kan angives som udvælgelseskriterie (se nedenfor). Der er mulighed for at blade i listen (svaret på en list hedder D313) hvis der er mange forekomster i svaret.

Hvis et depot skal slettes som egenbeholdningsdepot kan list-funktionen anvendes til at finde de registrerede egenbeholdningsdepoter. Der er så mulighed for at afkrydse det depot, der skal slettes, og trykke F3 (afslut). Så returneres til det oprindelige skærbilled D312, som er udfyldt med oplysningerne om det valgte egenbeholdningsdepot. Herfra kan registreringen som egenbeholdningsdepot slettes som anvist på skærbilledet.

Hvis forespørgslen foretages af det kontoførende institut skal enten KI-identifikationen eller ejers aftalehaver angives. Så vises en liste (D313) med alle registrerede egenbeholdningsdepoter under den angivne KI-identifikation eller den angivne ejers aftalehaver.

Forespørgslen kan begrænses ved at udfylde flere felter i forespørgslen.

Det kontoførende institut kan kun få vist egne egenbeholdningsdepoter og andres egenbeholdningsdepoter, når depoterne føres i et kontoførende institut under den samme aftalehaver som det forespørgende kontoførende institut. Derfor skal en forespørgsel med angivelse af en fremmed deltagers aftalehaverident begrænses ved som minimum at angive KI-identifikationen.

Hvis forespørgslen foretages af ejeren af egenbeholdningsdepotet (Fondshandlere og storkunder) kan kun egne egenbeholdningsdepoter vises. Ejers aftalehaveridentifikation skal altid angives. Så vises en liste (D313) med alle egenbeholdningsdepoter registreret med den angivne aftalehaver som ejer.

Forespørgslen kan begrænses ved at udfylde flere felter i forespørgslen.

Hvis forespørgslen indsendes fra datacenter leveres svaret som infoer.

VP-standardsystem:

D312 anvendes. Svaret på en "list" vises i skærbilled D313.

Behandling i VP:

Oplysninger om registrerede egenbeholdningsdepoter til brug for beholdningssanktionering fremfindes i henhold til de indtastede udvælgelseskriterier.

Uddata:

Følgende info-meddelelse dannes ved indsendelse af forespørgslen via datacenter:

TI20360v Vis egenbeholdningsdepoter

DATAFELTER



SYSTEMVEJLEDNING

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 EGENBEHOLDNINGSDEPOT	
03 KI-IDENTIFIKATION	F
03 VAERDIPAPIRKONTONUMMER	F
03 SUB-IDENT-NUMMER	F
03 AH-EJER-IDENTIFIKATION	F

O = obligatorisk, F = frivillig

Slet egenbeholdningsdepot (TD20451v)

Formål:

At slette registreringen af et depot som egenbeholdningsdepot i relation til beholdningssanktionering.

Behandling hos centraldeltager:

Anmelder af transaktionen skal være:

- det kontoførende institut for værdipapirkontoen (KI)

Fondshandleres og storkunders egenbeholdningsdepoter kan registreres med virkning for beholdningssanktionering. Sletning af denne registrering kan foretages med transaktionen.

For obligatorisk henholdsvis frivillig udfyldelse af transaktionens felter se nedenfor.

VP-standardsystem:

D312 anvendes.

Behandling i VP:

Godkendte inrapporteringer medfører at de angivne værdipapirkontonumre slettes fra register over egenbeholdningsdepoter til brug for beholdningssanktionering.

Uddata:

Ingen.

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 EGENBEHOLDNINGSDEPOT	
03 KI-IDENTIFIKATION	O
03 VAERDIPAPIRKONTONUMMER	O
03 SUB-IDENT-NUMMER	F
03 AH-EJER-IDENTIFIKATION	O

O = obligatorisk, F = frivillig'

Dellevering af CCP-handler i en afviklingskørsel

Ved handel til eller fra en Central Modpart (CCP) laver VP - ved manglende dækning i beholdning - en automatiseret dellevering. Delleveringsordningen er obligatorisk.

Der foretages p.t. kun dellevering i blok 40, men systemet er forberedt til eventuel fremtidig dellevering i andre blokke.



SYSTEMVEJLEDNING

Dellevering/split

Når leveringer til eller fra en CCP eller mellem to CCP'er ikke kan gennemføres på grund af manglende beholdning foretages der en dellevering.

Delleveringen foregår automatisk efter beholdningskontrollen ved at splitte handlen, der ikke er dækning for, i én handel, der kan gennemføres, og én handel der udskydes til den næste mulige blok. Den oprindelige handel annulleres, da den ved opsplitningen er blevet erstattet af de to nye.

De nye preadvices genereres ud fra oplysningerne i det oprindelige preadvice.

Handlen til gennemførelse dannes med den mængde, der er dækning for, og handelsbeløbet beregnes forholdsmaessigt i forhold til den gennemførte mængde og med udgangspunkt i salgets handelsbeløb. Status/årsag sættes til 15/3 (klar til afvikling/instruct modtaget).

Handlen, der ikke kan gennemføres (udskydes), dannes med den resterende mængde og det resterende handelsbeløb med udgangspunkt i salgets handelsbeløb. Status/årsag sættes på fragangs siden til 15/1 (klar til afvikling/manglende dækning i beholdning) og på tilgangssiden 15/10 (klar til afvikling/ikke gennemført på grund af modpost). CCP-handler, der ikke gennemføres senest i blok 40, udskydes direkte til blok 10 på den efterfølgende afviklingsdag.

De to nye handler tildeles nye afsender-referencenumre, som genereres af VP. I feltet "ekstern posteringstekst" i de nye handler indsættes teksten CCP efterfulgt af den oprindelige anmelder og det oprindelige referencenr. (CCP 01111-REFERENCENUMMER).

Det oprindelige preadvice, der annulleres, bliver påført status/årsag 11/63 (handel annuleret/CCP-dellevering).

Alle andre oplysninger end ovennævnte vil i de to nye preadvices blive kopieret fra det oprindelige preadvice.

Delleveringsprocessen kan også medføre at en CCP-handel, der blev udskudt ved den almindelige beholdningskontrol, bliver genoplivet i sin helhed. Det betragtes ikke som en dellevering i forhold til ovennævnte status-/årsagskoder og posteringstekst ligesom de nedennævnte info'er om opsplitning naturligvis ikke dannes. Det er altså ikke synligt for deltageren, at handlen i første omgang blev udskudt ved beholdningskontrollen.

Orientering om opsplitning med henblik på dellevering

De involverede parter orienteres med nye infoer om opsplitningen af den oprindelige handel.

Det er vigtigt at disse infoer i datacentrene behandles inden de øvrige infoer fra afviklingskørslen, da de jo informerer om nye referencenumre, der vil forekomme i de øvrige infoer om handlerne.

- TI201141 vedrørende opsplitningen sendes til de involverede parter.
Infoen indeholder oplysning om den oprindelige afsenderreference og de nytildelte referencer til henholdsvis preadvice til gennemførelse og preadvice til udskydelse.
Se dataindholdet i info-strukturen.
- TI201151 vedrørende den ændrede likviditet sendes til de involverede betalingsstillere.
Infoen indeholder oplysninger om den ændrede likviditet afledt af opsplitningen.
Se dataindholdet i info-strukturen.

Da blok 40 er den seneste afviklingsblok for CCP-handler, vil disse handler aldrig indgå i dagens senere blokke. Ved makkersøgning efter blok 40 vil den tidligst mulige afviklingsblok derfor være blok 10 på den efterfølgende afviklingsdag.

Dellevering af CCP-handler finder sted efter den almindelige beholdningskontrol. Derfor kan modtagne beholdninger fra delleveringer kun bruges til leveringer til eller fra CCP'er.



SYSTEMVEJLEDNING

Udvælgelsesrækkefølge for handler til dellevering

Hvis der mellem et bestemt depot og en bestemt CCP er både køb og salg, som er blevet udskudt fra beholdningskontrollen på grund af manglende dækning, vil den beholdning, der er dækning for, blive gennemført, og differencen vil indgå i delleveringsprocessen med mulighed for gennemførelse.

Hvis der ved forsøg på dellevering er flere salg, der kan komme i betragtning, vil der blive udvalgt efter følgende kriterier i den nævnte rækkefølge:

Ældste handelsdato.

Største handelsbeløb.

Minimumsbeløb for dellevering

Der er fastsat et minimumsbeløb for en dellevering. Handelsbeløbet i den handel, der kan delleveres, skal udgøre mindst 50.000 kr.

Rente- og udbyttefunktioner

Etablering af valutakorrektionsbeløb (TC20102v)

Formål:

At inrapportere et korrektionsbeløb mellem to valutaer.

Korrektionsbeløbet benyttes, når der omregnes til basisvaluta (danske kroner) til brug for indberetning til SKAT.

Behandling hos centraldeltager:

Det er pengekontoførende institut, der kan inrapportere korrektionsbeløbet. Det pengekontoførende institut kan også vælge at benytte det af Finansrådet fastsatte korrektionsbeløb, og skal så ikke selv inrapportere et korrektionsbeløb.

Deltageridentifikation skal være pengekontofører.

Både valutaen, der korrigeres fra, og valutaen der korrigeres til, skal være oprettet som valutaer. Danmarks Nationalbank gennemfører clearing i.

Starttidspunktet skal udfyldes med dato og træder i kraft ved dagens start.

Sluttidspunktet kan udfyldes med dato og indtræder ved dagens afslutning.

Satsen er den sats, der skal fratrækkes/tillægges den officielle valutakurs. Satsen skal være større end eller lig med 0.

Det kontrolleres efterfølgende, at det inrapporterede korrektionsbeløb er korrekt.

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at den inrapporterende deltager har autorisation til at inrapportere korrektionsbeløb på pengekontoførers vegne.

Ved oprettelse af et nyt korrektionsbeløb med en fremtidig dato sættes sluttidspunktet på det tidligere inrapporterede korrektionsbeløb lig med det nye starttidspunkt.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:



SYSTEMVEJLEDNING

TI20109v	Etablering af valutakorrektion (PK)	
TI20112v	Etablering af valutakorrektion – Finansrådet	(til alle PK)
TI20141v	Lukning af valutakorrektion (PK)	
TI20113v	Lukning af valutakorrektion – Finansrådet (til alle PK)	

DATAFELTER

02 ANMELDELSE		
03 AFSENDER-REFERENCE	O	
02 DELTAGER.		
03 IDENTIFIKATION	O	
02 VALUTA-FRA. (VALUTA)		
03 ISO-KODE	O	
02 VALUTA-TIL. (VALUTA)		
03 ISO-KODE	O	
02 VALUTA-KORREKTION.		
03 STARTTIDSPUNKT	O	
03 SLUTTIDSPUNKT	/	
03 SATS	O	
03 TILLAEG-FRADRAG-KODE	O	

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Ændring af valutakorrektionsbeløb (TU20102v)

Formål:

At ændre et allerede etableret korrektionsbeløb.

Behandling hos centraldeltager:

Det pengekontoførende institut kan ændre korrektionsbeløbet til og med renteperiodens startdato.

Satsen, der skal fratrækkes/tillægges den officielle valutakurs, skal være større end eller lig med 0.

Det kontrolleres efterfølgende, at ændringen er korrekt.

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at den indrapporterende deltager har autorisation til at indrapportere korrektionsbeløb på pengekontoførers vegne.

Ændring af korrektionsbeløb kan kun ske, hvis starttidspunktet er fremtidigt.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20118v	Ændring af valutakorrektion (PK)
TI20132v	Ændring af valutakorrektion - Finansrådet (til alle PK)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
---------------	--



SYSTEMVEJLEDNING

03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER.	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VALUTA-FRA. (VALUTA)	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA-TIL. (VALUTA)	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA-KORREKTION.	
03 STARTTIDSPUNKT	O
03 SLUTTIDSPUNKT	/
03 SATS	O
03 TILLAEG-FRADRAG-KODE	O

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Sletning af valutakorrektionsbeløb (TD20102v)

Formål:

At slette et korrektionsbeløb mellem to valutaer.

Behandling hos centraldeltager:

Det pengekontoførende institut kan slette allerede etablerede korrektionsbeløb.

Sluttidspunktet skal udfyldes med det tidspunkt, hvorfra den aktuelle sats ikke mere må benyttes.
Slutdatoen skal være fremtidig.

Hvis korrektionsbeløbet, som ønskes slettet, har en fremtidig dato kontrolleres det, at korrektionsbeløbet er slettet ellers kontrolleres det, at sluttidspunktet er sat til afslutningen på den inrapporterede dag.

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at anmelderen er pengekontoførende institut.

Hvis det er et fremtidigt korrektionsbeløb der slettes, benyttes det aktuelle korrektionsbeløb for endnu en periode.

Er det et aktuelt korrektionsbeløb der slettes, og der ikke inrapporteres et nyt beløb, benyttes Finansrådets korrektionbeløb for den næste periode til omregning fra en valuta til danske kroner.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20141v	Lukning af valutakorrektion (PK)
TI20113v	Lukning af valutakorrektion – Finansrådet (til alle PK)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER.	
03 IDENTIFIKATION	O



SYSTEMVEJLEDNING

02 VALUTA-FRA. (VALUTA)	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA-TIL. (VALUTA)	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA-KORREKTION.	
03 STARTTIDSPUNKT	O
03 SLUTTIDSPUNKT	O
03 SATS	/
03 TILLAEG-FRADRAG-KODE	/

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Forespørgsel på valutakorrektionsbeløb (TR20102v)

Formål:

At forespørge på et korrektionsbeløb mellem to valutakurser.

Behandling hos centraldeltager:

Alle kan forespørge på Finansrådets korrektionsbeløb. Den enkelte pengekontofører kan kun spørge på egne korrektionsbeløb.

Forespørges der på et specifikt korrektionsbeløb mellem to valutaer, skal starttidspunktet udfyldes. Er starttidspunktet ikke udfyldt, vil det aktuelle korrektionsbeløb blive oplyst.

Behandling i VP:

Er der flere korrektionsbeløb mellem to valutaer, og starttidspunktet ikke er angivet, vil det aktuelle korrektionsbeløb blive oplyst i svaret.

Uddata:

Svar på forespørgslen.

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER.	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VALUTA-FRA. (VALUTA)	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA-TIL. (VALUTA)	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA-KORREKTION.	
03 STARTTIDSPUNKT	O
03 SLUTTIDSPUNKT	/
03 SATS	/
03 TILLAEG-FRADRAG-KODE	/

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes



SYSTEMVEJLEDNING

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Renteflytning (TU20103v)

Formål:

At flytte rente mellem to værdipapirkonti's pengekonti for provenu. Renteflytningen kan ske, efter at renteberegningen har fundet sted og indtil den 30/12 i det år, hvor renterne indberettes til SKAT.

Behandling hos centraldeltager:

Deltageridentifikationen skal være kontoførende institut for værdipapirkontoen eller kontoførende relateret.

I perioden mellem renteberegningen og dannelsen af betalingsformidlingen kan renter flyttes med virkning for betalingsformidlingen.

Finder renteflytningen først sted efter betalingsformidlingen, vil flytningen alene få virkning for indberetningen til SKAT.

Er der tale om renter i en anden valuta end basisvalutaen (danske kroner), skal det omregnede beløb i basisvalutaen også angives, hvis flytningen sker efter dispositionsdagen.

Flytning af renter vil for eksempel være nødvendig i de situationer, hvor en handel til afvikling på renteberegningstidspunktet ikke er blevet afviklet som tilsigtet, eller hvor ændring af afkastkontoen på værdipapirkontoen ikke er blevet rettet som tilsigtet.

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at deltageren har lov til at flytte renten fra værdipapirkontoen.

Renteflytningen opdateres med det samme og får ankomsttiden som retsvirkningstidspunkt.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20127v	Renteflytning (KI)
TI20177v	Fragang i likviditet (PK)
TI20178v	Tilgang i likviditet (PK)
TI20182v	Nettopåvirkning i likviditet pr. dispositionsdag (PK)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENTER-REFERENCE	O
02 AFGIVENDE-KONTO	
03 DELTAGER	
04 IDENTIFIKATION	O
03 VAERDIPAPIRKONTO.	
04 NUMMER	O
03 BETALINGSSTED.	
04 REGISTRERINGSNUMMER	O
03 PENGEKONTO-KLASSIFICERING.	
04 TYPE	O
03 PENGEKONTO-FOR-PROVENU.	



SYSTEMVEJLEDNING

04 NUMMER	O
02 MODTAGENDE-KONTO	
03 DELTAGER.	
04 IDENTIFIKATION	O
03 VAERDIPAPIRKONTO.	
04 NUMMER	O
03 BETALINGSSTED.	
04 REGISTRERINGSNUMMER	F
03 PENGEKONTO-KLASSIFICERING.	
04 TYPE	F
03 PENGEKONTO-FOR-PROVENU.	
04 NUMMER	F
02 HANDELSPRODUKT.	
03 ISIN	O
02 FORFALD-AF-PROVENU.	
03 FORFALDSDATO	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 PROVENUTYPE.	
03 KODE	O
02 PROVENU.	
03 OMREGNET-BELOEB	O/F
03 UDBETALT-BELOEB	O

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Korrektion af omregnet rente- eller bruttoudbyttebeløb (TC20104v)

Formål:

At korrigere et omregnet rente- eller bruttoudbyttebeløb, når den automatisk omregnede værdi i basisvalutaen (danske kroner) ikke svarer til det faktisk udbetalte beløb.

Behandling hos centraldeltager:

Det kontoførende institut og det pengekontoførende institut kan korrigere det omregnede beløb på en værdipapirkonto.

Deltageridentifikationen skal være kontoførende institut for værdipapirkontoen eller kontoførende relateret eller pengekontoførende for betalingsstedet, hvor beløbet forfalder til betaling.

Beløbene kan korrigeres efter dispositionsdagen indtil den 30/12 i det år, hvor eventuel indberetning til Skat foretages.

Korrektionen vil få virkning for indberetningen til SKAT og vil fremgå af årsopgørelsen.

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at deltageren har lov til at korrigere beløbet på værdipapirkontoen.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:



SYSTEMVEJLEDNING

DATAFELTER

02 DELTAGER.	
03 IDENTIFIKATION	O
02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 VAERDIPAPIRKONTO.	
03 NUMMER	O
02 HANDELSPRODUKT.	
03 ISIN	O
02 PROVENUTYPE.	
03 KODE	O
02 FORFALD-AF-PROVENU.	
03 FORFALDSATO	O
02 BETALINGSSTED.	
03 REGISTRERINGSNUMMER	O
02 PENGEKONTO-KLASSIFICERING.	
03 TYPE	O
02 PENGEKONTO-FOR-PROVENU.	
03 NUMMER	O
02 PROVENU.	
03 OMREGNET-BELOEB	O

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Etablering af krydkurs for et handelsprodukt (TC20105v)

Formål:

At indrapportere en krydkurs for et handelsprodukt. Benyttes, når rente udbetales i en anden valuta end den, handelsproduktet er udstedt i.

Behandling hos centraldeltager:

Det udstedende institut skal indrapportere krydkursten.

Krydkursten skal være større end eller lig med nul.

Krydkurskoden angiver, om krydkursten er fast eller variabel i hele perioden. Er krydkursten fast, bruges den samme krydkurs til alle rentebetaler, ellers benyttes den krydkurs, der er registreret på renteberegningstidspunktet.

Startdatoen skal være fremtidig eller dags dato. Hvis der er oprettet rentekarakteristika, skal dato'en være lig med en startdato i en renteperiode.

Der skal være oprettet en default kontogruppering i den valuta, som der etableres krydkurs i.

Det kontrolleres efterfølgende, at den indrapporterede krydkurs er korrekt.



SYSTEMVEJLEDNING

Behandling i VP:

Krydkurserne offentliggøres på etableringstidspunktet eller samtidig med, at handelsproduktet bliver offentliggjort.

Det kontrolleres,

- at handelsproduktet er etableret.
- at krydkurserne er større end eller lig med nul.
- at startdatoen er en fremtidig dato eller dags dato. Hvis der er oprettet rentekarakteristika, skal datoerne være lig med en startdato i en renteperiode.
- at der er oprettet default kontogruppering i den valuta, der etableres krydkurs i.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20119v	Etablering af krydkurs for et handelsprodukt (UD)
TI20151v	Etablering af krydkurs for et handelsprodukt, kopi (DC)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 BETALING-I-ANDEN-VALUTA.	
03 STARTDATO	O
03 KRYDSKURS	O
03 KRYDSKURSKODE	O

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Ændring af krydkurs for et handelsprodukt (TU20105v)
Formål:

At ændre en allerede etableret krydkurs for et handelsprodukt.

Behandling hos centraldeltager:

Det udstedende institut kan ændre krydkurserne til og med renteperiodens startdato.

Krydkurserne skal være større end eller lig med nul.

Startdatoen kan ikke ændres.

Det kontrolleres efterfølgende, at den ændrede krydkurs er korrekt.

Behandling i VP:

Det kontrolleres, at handelsproduktet er etableret, og at anmelderen er udsteder af handelsproduktet.



SYSTEMVEJLEDNING

Hvis valutaen ændres, kontrolleres det, at der er oprettet en default kontogruppning i den valuta, der ændres til.

Krydkursen offentliggøres på ændringstidspunktet eller samtidig med, at handelsproduktet bliver offentliggjort.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20120v	Ændring af krydkurs for et handelsprodukt (UD)
TI20152v	Ændring af krydkurs for et handelsprodukt, kopi (DC)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 BETALING-I-ANDEN-VALUTA.	
03 STARTDATO	O
03 KRYDKURS	O
03 KRYDKURSKODE	O

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Sletning af krydkurs for et handelsprodukt (TD20105v)

Formål:

At slette en krydkurs for et handelsprodukt.

Behandling hos centraldeltager:

Det udstedende institut kan slette krydkursen til og med med næste renteperiodes startdato.

Det kontrolleres efterfølgende, at krydkursen er slettet.

Behandling i VP:

Det kontrolleres at handelsproduktet er etableret, og at anmelderen er udsteder af handelsproduktet.

Hvis krydkurs for første renteperiode slettes, kontrolleres det, at der er etableret en default kontogruppning i handelsproduktets udstedelsesvaluta.

Sletningen af krydkursen offentliggøres på slettetidspunktet, hvis handelsproduktet er offentliggjort, ellers ikke.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20121v	Sletning af krydkurs for et handelsprodukt (UD)
TI20153v	Sletning af krydkurs for et handelsprodukt, kopi (DC)



SYSTEMVEJLEDNING

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 BETALING-I-ANDEN-VALUTA.	
03 STARTDATO	O
03 KRYDSKURS	/
03 KRYDSKURSKODE	/

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Forespørgsel på krydkurs for et handelsprodukt (TR20105v)

Formål:

At forespørge på en krydkurs for et handelsprodukt.

Behandling hos centraldeltager:

Alle kan forespørge på krydkurserne. Forespørges der på en fortidig eller en fremtidig krydkurs, skal startdatoen angives, ellers oplyses den aktuelle krydkurs.

Behandling i VP:

Er der flere krydkurser for handelsproduktet, og startdatoen ikke er angivet, vil den aktuelle krydkurs blive oplyst i svaret.

Uddata:

Svar på forespørgslen.

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 HANDELSPRODUKT	
03 ISIN	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 BETALING-I-ANDEN-VALUTA.	
03 STARTDATO	O
03 KRYDSKURS	/
03 KRYDSKURSKODE	/

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)



SYSTEMVEJLEDNING

Forespørgsel på valuta notering (TR20106v)

Formål:

At forespørge på en valuta notering.

Behandling hos centraldeltager:

Alle kan forespørge på valuta notering.

Ved udfyldelse af basis valuta og den ønskede valuta vises senest registrerede valuta notering.

Der kan bladres tilbage til foregående noteringstidspunkt for denne valuta notering.

Behandling i VP:

Er der flere valuta noteringer, og noteringstidspunktet ikke er angivet, vil den aktuelle valuta notering blive oplyst.

Uddata:

Svar på forespørgslen.

DATAFELTER

02 DELTAGER	
03 IDENTIFIKATION	F
02 VALUTA	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA	
03 ISO-KODE	O
02 VALUTA-NOTERING	
03 NOTERINGSTIDSPUNKT	/
03 KURS	/

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Forespørgsel på indeksfaktor (TR20107v)

Formål:

At forespørge på indeks - og korrektionsfaktor på indekspapirer.

Behandling hos centraldeltager:

Alle kan forespørge på indeks- og korrektionsfaktor. Spørges der på en fortidig eller en fremtidig indeks- og korrektionsfaktor, kan startdatoen for disse angives. Der kan bladres til ønsket indeks- og korrektionsfaktors startperiode.

Uddata:

Svar på forespørgslen.

DATAFELTER

02 INDEKSTYPE.	
03 NUMMER	O
02 INDEKS.	
03 TIDSPUNKT	F



SYSTEMVEJLEDNING

03 FAKTOR	F
03 KORREKTIONFAKTOR	F

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Forespørgsel på provenu (TR20113v)

Formål:

At forespørge på provenu tilknyttet en værdipapirkonto.

Behandling hos centraldeltager:

Det kontoførende institut kan forespørge på provenuet, efter at det er beregnet, og indtil det slettes fra værdipapirkontoen.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20155v Svar på forespørgsel, provenu (KI)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE.	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER.	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VAERDIPAPIRKONTO.	
03 NUMMER	O
02 HANDELSPRODUKT.	
03 ISIN	O
02 PROVENUTYPE.	
03 KODE	O
02 FORFALD-AF-PROVENU.	
03 FORFALDSATO	F

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Forespørgsel på provenubevægelser (TR20114v)

Formål:

At forespørge på provenubevægelser foretaget på en værdipapirkonto.

Behandling hos centraldeltager:

Det kontoførende institut kan forespørge på provenubevægelser på en værdipapirkonto indtil provenuet er slettet.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:



SYSTEMVEJLEDNING

TI20156v

Svar på forespørgsel, provenubevægelser (KI)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE.	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER.	
03 IDENTIFIKATION	O
02 VAERDIPAPIRKONTO.	
03 NUMMER	O
02 HANDELSPRODUKT.	
03 ISIN	O
02 FORFALD-AF-PROVENU.	
03 FORFALDSDATO	O
02 PROVENUTYPE.	
03 KODE	O

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

Kontogrupperinger

Kontogruppering, generelt.

Det udstedende institut der udsteder obligationer, skal for hver valuta etablere en default kontogruppering for henholdsvis rente og udtrukne andele (kontotype), som provenuet skal afregnes i. Kontogrupperinger skal være oprettet inden VP foretager renteberegning eller udtrækning.

Derudover kan der etableres ikke-default kontogrupperinger for de valutaer og kontotyper (udtrækning, rente), som instituttet i forvejen har etableret en default kontogruppering for.

For ikke-default kontogruppering kan der angives en periode, som kontogrupperingen skal gælde for. For default kontogruppering skal der angives en startdato lig dagsdato, men slutdatoen må ikke angives.

VP anvender den kontogruppering, som har den samme valuta som provenuet skal afregnes i for den pågældende kontotype (udtrækning, rente).

Ikke-default kontogruppering anvendes for de handelsprodukter der er tilknyttet denne, hvis startdatoen er nået og slutdatoen endnu ikke er nået.

I alle andre tilfælde vil default kontogruppering blive anvendt.

Et handelsprodukt kan kun tilknyttes en ikke-default kontogruppering, hvis det ikke i forvejen er tilknyttet en anden ikke-default kontogruppering i samme valuta og kontotype som dækker samme eller en del af perioden.

Handelsproduktet skal tilknyttes pr. kontotype (udtrækning, rente) i den valuta provenuet skal afregnes i.

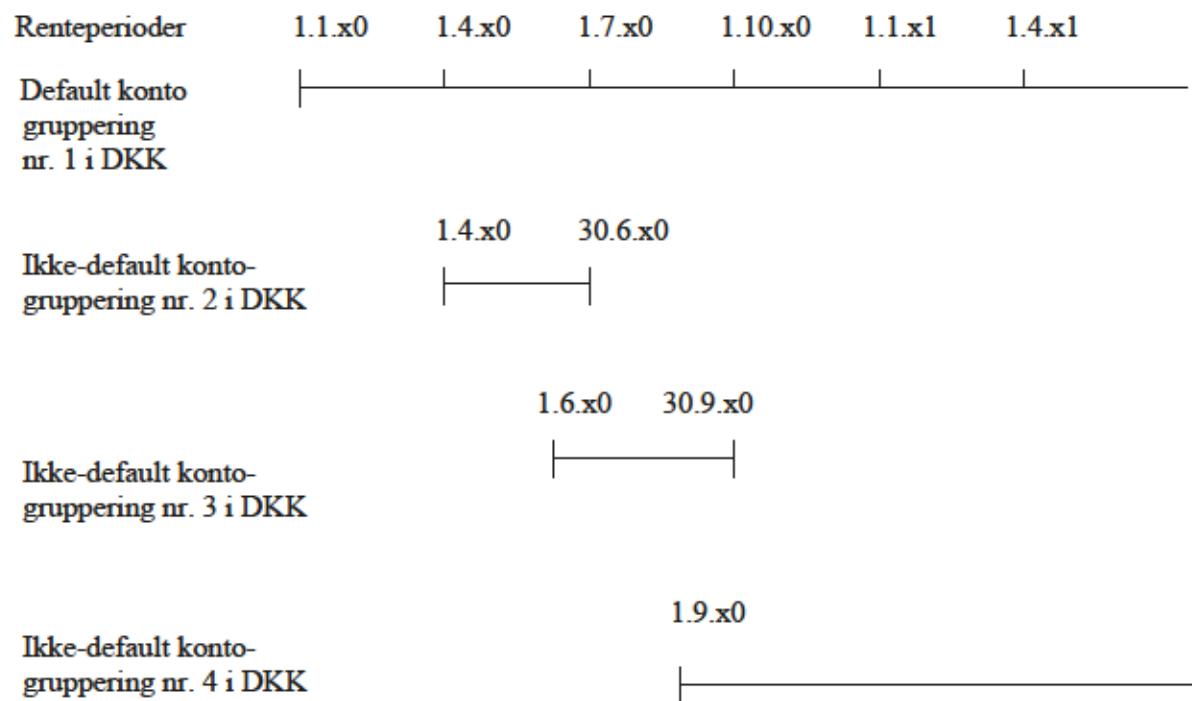


SYSTEMVEJLEDNING

Ønskes en default kontogruppning erstattet af en ny default kontogruppning, etableres den nye som default kontogruppning. Den eksisterende default kontogruppning bliver automatisk ændret til en ikke-default.

Eksempel på kontogruppning.

Eksempel nr. 1



I dette eksempel tilknyttes handelsproduktet til kontogruppning nr. 2 og nr. 4. Systemet giver ikke adgang til at tilknytte handelsproduktet til kontogruppning nr. 3 fordi der er overlappende perioder (kontogruppning nr. 2 og nr. 3).

Handelsproduktets udstedelsesvaluta er i DKK, renten og udtrukne andele skal afregnes i DKK.

Ved renteberegning og ved dannelsen af betalingsformidlingsgrundlag for udtrækning anvendes følgende kontogruppinger:

- termin 1.4.x0, anvendes kontogruppning nr. 1.
- termin 1.7.x0, anvendes kontogruppning nr. 2.
- termin 1.10.x0, anvendes kontogruppning nr. 1.
- termin 1.1.x1 og fremover anvendes kontogruppning nr. 4.

Eksempel nr. 2



SYSTEMVEJLEDNING

Renteperioder	1.1.x0	1.4.x0	1.7.x0	1.10.x0	1.1.x1	1.4.x1
Default kontogruppering nr. 1 i DKK						
Default kontogruppering nr. 2 i NOK						
	1.4.x0		30.6.x0			
Ikke-default konto-gruppering nr. 3 i DKK						
	1.7.x0			31.12.x0		
Ikke-default konto-gruppering nr. 4 i DKK 1.9.x0						
	1.9.x0					
Ikke-default konto-gruppering nr. 5 i NOK						

I dette eksempel tilknyttes handelsproduktet til kontogruppering nr. 3, nr. 4 og nr. 5.

Handelsproduktets udstedelsesvaluta er i DKK og renten skal afregnes i NOK den 1.10.x0. Der er etableret krydkurs gældende fra 1.7.x0 og fremover.

Ved renteberegning anvendes følgende kontogrupperinger:

- termin 1.4.x0, anvendes kontogruppering nr. 1.
- termin 1.7.x0, anvendes kontogruppering nr. 3.
- termin 1.10.x0, anvendes kontogruppering nr. 2. ¹⁾
- termin 1.1.x1 og fremover anvendes kontogruppering nr. 5.

Etablering af kontogruppering (TC20110v)

Formål:

At etablere en gruppe af konti med tilhørende procentfordeling til brug for en periodisk betaling af rente eller af udtrukne andele.

¹⁾ Er der overlappende perioder mellem to kontogrupperinger, vil VP anvende den kontogrupperingen som renten skal afregnes i.



SYSTEMVEJLEDNING

Behandling hos centraldeltager:

Der kan kun tilknyttes én valuta pr. kontogruppering, og alle debetkonti, der tilknyttes skal have samme valuta som kontogrupperingen. Procenten for hver debetkonto skal angives, og summen skal være 100%.

Det vil være den eller de debetkonto(i) som udstederen har registreret i VP, der kan anvendes i henhold til udstederens aftaleforhold med VP.

Identifikationen af en kontogruppering skal være entydig hos udstederen og vælges af udstederen selv.

Der kan kun etableres én kontogruppering med koden default pr. kontotype (udtrækning, rente) pr. valuta.

Kun for rente:

Ved etablering af kontogruppering, kan der ske ændring til de beregnede provenuer, som endnu ikke er betalingsformidlet. Dette er nærmere beskrevet i afsnit 2.

Der kan ikke angives slutdato på en default kontogruppering.

For default kontogruppering skal startdato være dags dato. For ikke-default kontogruppering skal startdato være dags dato eller en fremtidig dato.

Behandling i VP:

Det kontrolleres,

- at der er etableret en default kontogruppering med samme kontotype (udtrækning, rente) og med samme valuta når en ikke-default kontogruppering skal etableres.
- at debetkonti, der tilknyttes en kontogruppering, har samme valuta som kontogrupperingen.
- at startdato er dags dato for en default kontogruppering.
- at startdato er dags dato eller en fremtidig dato for en ikke-default kontogruppering.
- at slutdatoen ikke er angivet for en default kontogruppering.
- at summen af procenter for inrapportererde kontoreferencenumre er 100%.

Uddata:

Der dannes følgende info-meddelelser:

TI20122v	Etablering af kontogruppering (UD)
TI20123v	Ændring af kontogruppering (UD)
TI20136v	Pengetræk pr. debetkonto i en kontogruppe (UD)
TI20107v	Tilgang i likviditet på en debetrentekonto (PK)
TI20168v	Fragang i likviditet på en debetrentekonto (PK)
TI20182v	Nettopåvirkning i likviditet pr. afviklingskørsel (PK)

DATAFELTER

02 ANMELDELSE	
03 AFSENDER-REFERENCE	O
02 DELTAGER	
03 IDENTIFIKATION	O
02 KONTOGRUPPERING.	
03 IDENTIFIKATION	O
03 KODE	F 1)
03 STARTDATO	O
03 SLUTDATO	F 2)
02 KONTO-TYPE.	



SYSTEMVEJLEDNING

03 KODE	O
02 VALUTA.	
03 ISO-KODE	O
02 KONTOGRUPPE (20 forekomster)	
03 BETALINGSSTED.	
04 REGISTRERINGSNUMMER	O
03 KONTO-REFERENCE.	
04 NUMMER	O
03 PROCENTFORDELING-PAA-KONTI.	
04 PROCENT	O

O = obligatorisk, F = frivillig, / = skal ikke udfyldes

Et frivilligt felt, som ikke er udfyldt, vil automatisk blive udfyldt med default værdien ved modtagelsen i VP. (Se feltbeskrivelserne)

- 1) Feltet er obligatorisk, hvis der ikke er etableret en default kontogruppning med samme kontotype og med samme valuta.
- 2) Må ikke udfyldes for en default kontogruppning.

Ændring af kontogruppning (TU20110v)

Formål:

At ændre en kontogruppning for rente eller udtrukne andele.

Behandling hos centraldeltager:

Det udstedende institut kan ændre sammensætning af debetkonti, procentfordeling, kontogruppingskode. Der udover kan start- og slutdato ændres for ikke-default kontogruppinger.

Nye debetkonti kan tilføjes, hvis summen af procenter er 100.

Hvis en debetkonto skal ændres til en anden debetkonto, skal procentsatsen for den debetkonto, som skal udgå, ændres til 0. Den ny debetkonto tilføjes. Herefter kan debetkontoen med procentsatsen 0 fjernes ved at anvende transaktionen "Fjern debetkonti fra kontogruppning".

Kun for rente:

Ved ændring af kontogruppning, kan der ske ændring til de beregnede provenuer, som endnu ikke er betalingsformidlet. Dette er nærmere beskrevet i afsnit 3.

For en default kontogruppning må startdatoen ikke ændres og slutdatoen må ikke udfyldes.
For ikke-default kontogruppning skal startdato være dags dato eller en fremtidig dato.

Procenten for hver konto skal angives, og summen skal være 100%.

Oplysningerne på en kontogruppning kan ikke ændres når slutdatoen er næst.

Kontogruppingskode kan ændres fra ikke-default til default, men ikke fra default til ikke-default.

Behandling i VP:

Det kontrolleres,

- at debetkonti der tilknyttes en kontogruppning har samme valuta som kontogruppningen.
- at startdato ikke er ændret for en default kontogruppning.
- at startdato er dags dato eller en fremtidig dato for en ikke-default kontogruppning.